

■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円で為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として為替ヘッジは行いません。 	
組入制限	当ファンド	<ul style="list-style-type: none"> ■株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■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、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。		
	分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。		
	※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。		
	ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向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)】

(2021年9月11日から2022年9月12日まで)

第 5 期

決算日 2022年9月12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)

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

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

■ 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク)合成指数		株式組入比率	株式先物比率 (買建-売建)	公社債組入比率	投資信託証券組入比率	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
4期(2021年9月10日)	12,869	0	20.0	133.41	21.1	35.9	2.5	39.1	21.2	1,014
5期(2022年9月12日)	13,461	0	4.6	140.38	5.2	36.8	1.4	39.0	21.5	1,634

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) 合成指数		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	公 社 債 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 率 比
	円	騰 落 率		騰 落 率				
(期 首) 2021年 9月10日	12,869	—	133.41	—	35.9	2.5	39.1	21.1
9 月 末	12,704	△1.3	131.76	△1.2	35.0	3.0	39.6	20.9
10 月 末	13,140	2.1	136.29	2.2	34.8	3.5	38.7	21.4
11 月 末	12,967	0.8	134.56	0.9	33.6	3.9	39.7	20.9
12 月 末	13,283	3.2	137.97	3.4	35.3	2.9	38.7	21.5
2022年 1 月 末	12,766	△0.8	132.60	△0.6	34.8	3.0	39.5	21.1
2 月 末	12,644	△1.7	131.34	△1.5	34.7	3.0	39.6	21.1
3 月 末	13,355	3.8	138.81	4.0	35.5	3.2	38.4	21.4
4 月 末	13,169	2.3	136.87	2.6	34.8	2.7	39.9	21.0
5 月 末	13,029	1.2	135.53	1.6	35.1	3.4	38.8	21.0
6 月 末	12,940	0.6	134.67	0.9	35.4	2.4	39.7	20.9
7 月 末	13,224	2.8	137.77	3.3	35.3	2.7	38.8	21.5
8 月 末	13,192	2.5	137.57	3.1	35.3	2.6	39.6	20.8
(期 末) 2022年 9月12日	13,461	4.6	140.38	5.2	36.8	1.4	39.0	21.5

※騰落率は期首比です。

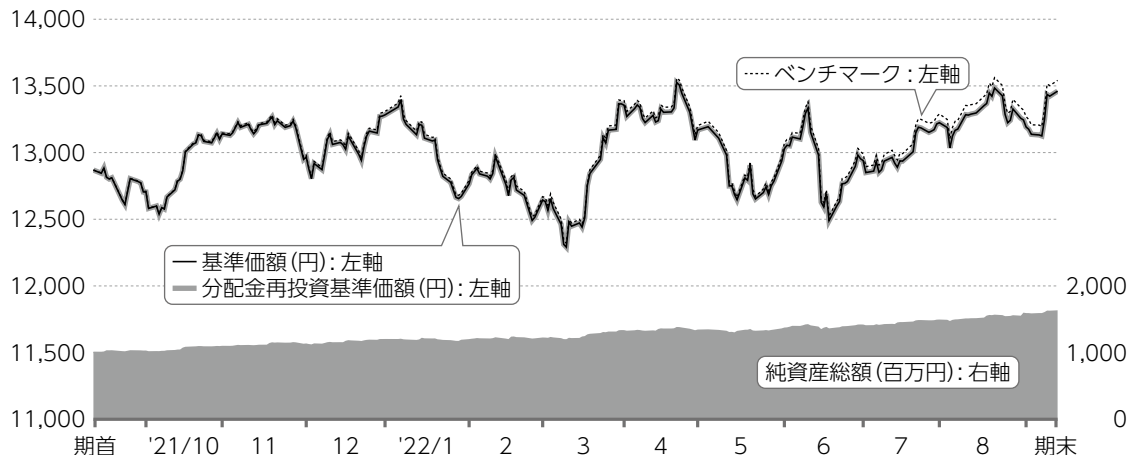
※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年9月11日から2022年9月12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	12,869円
期末	13,461円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+4.6% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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

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

※当ファンドのベンチマークは、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(2021年9月11日から2022年9月12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

- 米ドル、ユーロ、主な新興国通貨が円に対して上昇したこと

下落要因

- 先進国株式(国内含む)および新興国株式市場が下落したこと
- 国内外の金利が上昇(債券価格は下落)したこと
- グローバルリート市場が下落したこと

投資環境について(2021年9月11日から2022年9月12日まで)

期を通して見ると、国内株式市場、先進国株式市場、新興国株式市場は、それぞれ下落しました。債券市場では、国内外で金利が上昇しました。リート市場は、国内は横ばいでしたが、グローバル市場は下落しました。外国為替市場では、米ドルやユーロに加え、主な新興国通貨も概ね、円に対して上昇しました。

株式市場

●先進国外国株式

期を通じて、先進国外国株式市場は下落しました。

期初は、新型コロナウイルスで落ち込んだ経済の回復期待から上昇しました。しかし、年明け以降、物価上昇の企業業績への影響や、世界各国の中央銀行による金融引き締め姿勢、ウクライナ情勢等が懸念され、下落基調で推移しました。

●国内株式

期を通じて、国内株式市場は下落しました。

物価上昇の企業業績への影響や、中国による都市封鎖、世界各国の中央銀行による金融引き締め姿勢が懸念され、下落基調で推移しました。

●新興国株式

期を通じて、新興国株式市場は下落しました。

世界各国の中央銀行による利上げや、ウクライナ問題といった地政学リスクが顕在化したことで、下落基調で推移しました。

債券市場

●先進国外国債券

米国の長期金利(10年国債利回り)は、期を通じて上昇しました。FRB(米連邦準備制度理事会)が物価上昇への対応として金融引き締め姿勢を明確にしたため、金利は上昇基調で推移しました。景気悪化懸念から金利は一時低下する局面がありましたが、FRBが金融引き締め姿勢を崩さなかったことで、期末にかけて再び上昇基調となりました。

欧州の長期金利(ドイツの10年国債利回り)は、期を通じて上昇しました。欧州圏内の物価上昇やFRBの金融引き締め姿勢を受けて、ECB(欧州中央銀行)も金融緩和縮小へ舵を切りました。その結果、金利は上昇基調で推移しました。エネルギー価格の高騰等に伴う、景気悪化懸念から、金利

は一時低下する局面もありましたが、期初と比べると上昇で着地しました。

●国内債券

長期金利は、期を通じて上昇しました。

日銀は一貫して金融緩和姿勢を維持しましたが、世界各国との金利差拡大に伴う大幅な円安を受けて、市場では日銀は緩和姿勢の修正を迫られるとの見方が生まれ、金利は上昇しました。

リート市場

●グローバルリート

期を通じて、グローバルリート市場は下落しました。

期初は、新型コロナウイルスで落ち込んだ経済の回復期待から上昇する場面もありました。しかしその後は、世界各国の金利上昇や、ウクライナ問題等で株式市場が軟調に推移したことが逆風となり、大きく下落しました。

●国内リート

期を通じて、国内リート市場は概ね横ばいでした。

年明け以降、国内金利の上昇に伴い、下落した場面がありましたが、その後、国内経済の回復期待等を材料に上昇しました。以降は、概ね横ばいで推移しました。

為替市場

●米ドル・円

期を通じて、米ドル高・円安となりました。

期初は、横ばいで推移しました。その後は、FRBが金融引き締めを積極化した一方で日銀が緩和姿勢を維持したことで日米金利差が拡大し、米ドル高・円安基調となりました。

●ユーロ・円

期を通じて、ユーロ高・円安となりました。

期初はもみ合いの展開でしたが、欧州金利と日本の金利差拡大に伴い、ユーロ高・円安基調となりました。期末には、欧州でのエネルギー価格高騰等で、景気悪化懸念が出てきたことでユーロ安の動きとなりましたが、期初と比べるとユーロ高・円安で着地しました。

●新興国通貨

期を通じて、新興国通貨は概ね円に対して上昇しました。特に日本との金利差拡大が意識されました。

一方で、トルコでは大幅な物価上昇や利下げが材料視され、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(2021年9月11日から2022年9月12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：金利の変動による債券価格の感応度)、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。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(除く日本、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、TOPIXに採用されている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

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。

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M S C I 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。

また2、5、8、11月末のM S C I エマージング・マーケット・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。

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R E I T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

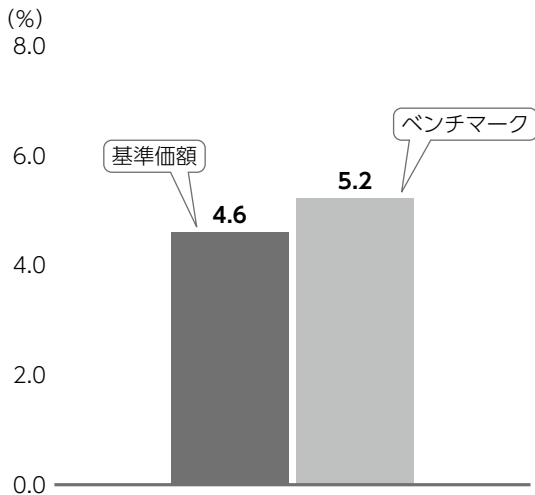
S & P 先進国R E I T指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

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(2021年9月11日から2022年9月12日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは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

基準価額の騰落率は+4.6% (分配金再投資ベース) となり、ベンチマークの騰落率+5.2%を0.6%下回りました。

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(2021年9月11日から2022年9月12日まで)

(単位:円、1万口当たり、税引前)

項目	第5期
当期分配金	0
(対基準価額比率)	(0.00%)
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	3,460

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りとしたしました。なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

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

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

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、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(除く日本、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。

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

債券組入比率は高位に保つことを基本とします。

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、日々の資金流入出に対応し、迅速なリバランスを行います。

債券組入比率は高位に保つことを基本とします。

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(2021年9月11日から2022年9月12日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	30円	0.232%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 期中の平均基準価額は12,998円です。
(投信会社)	(13)	(0.099)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(14)	(0.111)	販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	4	0.028	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(2)	(0.013)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(投資信託証券)	(2)	(0.012)	
(c) 有価証券取引税	1	0.008	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.005)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.003)	
(d) その他費用	7	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)	(5)	(0.039)	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
(監査費用)	(1)	(0.007)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(1)	(0.007)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	42	0.321	

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

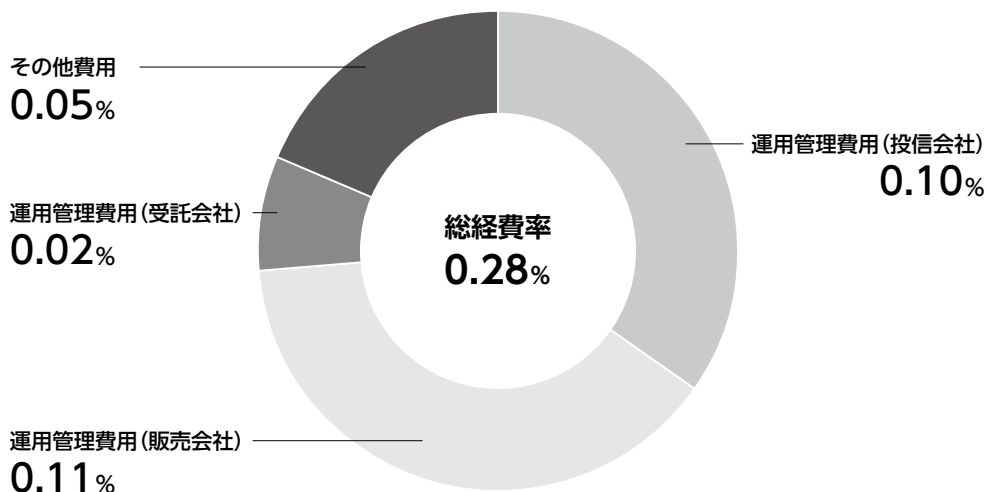
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。



参考情報 総経費率(年率換算)



※各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

※各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。

※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率換算)は0.28%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年9月11日から2022年9月12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)	18,104	58,663	426	1,388
外国株式インデックス・マザーファンド	19,293	111,014	3,517	21,206
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	26,061	36,613	—	—
外国債券パッシブ・マザーファンド	57,858	115,155	1,297	2,583
国内債券パッシブ・マザーファンド	78,961	99,635	3,111	3,924
Jリート・インデックス・マザーファンド	11,083	29,521	—	—
外国リート・インデックス・マザーファンド	28,183	79,865	5,901	18,130
エマーシング株式インデックス・マザーファンド	35,802	59,758	—	—

■ 親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年9月11日から2022年9月12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	エマーシング株式 インデックス・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	46,915,166千円	93,074,430千円	87,307千円	10,397,845千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	201,075,880千円	352,206,366千円	—	13,153,826千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.23	0.26	—	0.79

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年9月11日から2022年9月12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

当期中における利害関係人との取引等はありません。

国内債券パッシブ・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	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公 社 債	百万円 56,976	百万円 1,289	% 2.3	百万円 57,835	百万円 2,084	% 3.6

※平均保有割合 0.1%

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

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	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株 式	百万円 32,051	百万円 1,451	% 4.5	百万円 14,863	百万円 4,136	% 27.8
株 式 先 物 取 引	55,669	42,714	76.7	53,999	42,046	77.9

※平均保有割合 0.1%

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

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	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投 資 信 託 証 券	百万円 6,137	百万円 309	% 5.0	百万円 3,252	百万円 842	% 25.9

※平均保有割合 0.7%

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

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

外国株式インデックス・マザーファンド

エマージング株式インデックス・マザーファンド

外国リート・インデックス・マザーファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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 100

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 230	百万円 46	百万円 2,342

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 500

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 32

(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	365千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	6千円
(c) (b) / (a)	1.7%

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

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2021年9月11日から2022年9月12日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2022年9月12日現在)

親投資信託残高

種 類	期 首(前期末)	期 末	評 価 額
	口 数	口 数	
	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)	30,472	48,149	161,840
外国株式インデックス・マザーファンド	35,998	51,775	328,763
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	32,203	58,264	75,650
外国債券パッシブ・マザーファンド	101,717	158,279	325,453
国内債券パッシブ・マザーファンド	117,119	192,969	239,706
Jリート・インデックス・マザーファンド	17,827	28,910	80,001
外国リート・インデックス・マザーファンド	56,813	79,095	245,646
エマージング株式インデックス・マザーファンド	58,243	94,046	161,749

※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)	64,681,311,514口	外国株式インデックス・マザーファンド	69,094,291,205口
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	20,045,986,946口	外国債券パッシブ・マザーファンド	76,795,410,154口
国内債券パッシブ・マザーファンド	105,070,373,916口	Jリート・インデックス・マザーファンド	3,618,768,466口
外国リート・インデックス・マザーファンド	8,375,587,967口	エマージング株式インデックス・マザーファンド	14,201,860,735口

■ 投資信託財産の構成

(2022年9月12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）	161,840	9.9
Jリート・インデックス・マザーファンド	80,001	4.9
国内債券パッシブ・マザーファンド	239,706	14.6
外国株式インデックス・マザーファンド	328,763	20.1
外国リート・インデックス・マザーファンド	245,646	15.0
エマージング株式インデックス・マザーファンド	161,749	9.9
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	75,650	4.6
外国債券パッシブ・マザーファンド	325,453	19.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	20,533	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	1,639,346	100.0

※外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（437,168,343千円）の投資信託財産総額（439,029,741千円）に対する比率は99.6%です。

※ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（26,653,159千円）の投資信託財産総額（26,788,370千円）に対する比率は99.5%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（156,643,546千円）の投資信託財産総額（158,950,545千円）に対する比率は98.5%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（25,975,049千円）の投資信託財産総額（26,040,150千円）に対する比率は99.7%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（24,367,247千円）の投資信託財産総額（24,472,784千円）に対する比率は99.6%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=142.82円、1カナダ・ドル=109.72円、1オーストラリア・ドル=97.75円、1香港・ドル=18.19円、1シンガポール・ドル=102.10円、1ニュージーランド・ドル=87.26円、1台湾・ドル=4.615円、1イギリス・ポンド=165.87円、1エジプト・ポンド=7.389円、1イスラエル・シケル=41.889円、1スイス・フラン=148.85円、1トルコ・リラ=7.839円、1デンマーク・クローネ=19.34円、1ノルウェー・クローネ=14.45円、1スウェーデン・クローナ=13.49円、1メキシコ・ペソ=7.19円、1フィリピン・ペソ=2.513円、100チリ・ペソ=15.698円、100コロンビア・ペソ=3.278円、1インド・ルピー=1.80円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1ブラジル・レアル=27.729円、1チェコ・コルナ=5.86円、100韓国・ウォン=10.36円、1オフショア・人民元=20.596円、1マレーシア・リンギット=31.738円、1南アフリカ・ランド=8.25円、1タイ・バーツ=3.92円、1ポーランド・ズロチ=30.661円、100ハンガリー・フォリント=36.317円、1ユーロ=143.83円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年9月12日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,639,346,013円
コーポレート・ローン等	20,138,383
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	161,840,159
Jリート・インデックス・マザーファンド(評価額)	80,001,016
国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	239,706,265
外国株式インデックス・マザーファンド(評価額)	328,763,834
外国リート・インデックス・マザーファンド(評価額)	245,646,562
エマージング株式インデックス・マザーファンド(評価額)	161,749,942
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	75,650,976
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	325,453,876
未 収 入	395,000
(B) 負 債	4,900,622
未 払 解 約 金	3,192,741
未 払 信 託 報 酬	1,660,443
そ の 他 未 払 費 用	47,438
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,634,445,391
元 本	1,214,217,954
次 期 繰 越 損 益 金	420,227,437
(D) 受 益 権 総 口 数	1,214,217,954口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	13,461円

※当期における期首元本額788,236,116円、期中追加設定元本額503,710,231円、期中一部解約元本額77,728,393円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2021年9月11日 至2022年9月12日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 4,907円
受 取 利 息	345
支 払 利 息	△ 5,252
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	69,322,530
売 買 益	88,308,087
売 買 損	△ 18,985,557
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,057,060
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	66,260,563
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	135,851,589
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	218,115,285
(配 当 等 相 当 額)	(147,699,755)
(売 買 損 益 相 当 額)	(70,415,530)
(G) 合 計(D+E+F)	420,227,437
次 期 繰 越 損 益 金(G)	420,227,437
追 加 信 託 差 損 益 金	218,115,285
(配 当 等 相 当 額)	(148,482,314)
(売 買 損 益 相 当 額)	(69,632,971)
分 配 準 備 積 立 金	202,112,152

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

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

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	26,121,836円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	40,138,727
(c) 収益調整金	218,115,285
(d) 分配準備積立金	135,851,589
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	420,227,437
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	3,460.89
(f) 分配金	0
1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当 期
	0円

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

第17期（2021年5月26日から2022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。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合)		公社債 組入比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率		期中 騰落率		
13期(2018年5月25日)	12,628	0.8	382.10	0.8	99.4	206,843
14期(2019年5月27日)	12,860	1.8	388.97	1.8	98.7	165,548
15期(2020年5月25日)	12,846	△0.1	388.47	△0.1	99.7	137,939
16期(2021年5月25日)	12,790	△0.4	386.73	△0.4	99.4	130,401
17期(2022年5月25日)	12,598	△1.5	380.92	△1.5	99.4	133,094

※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

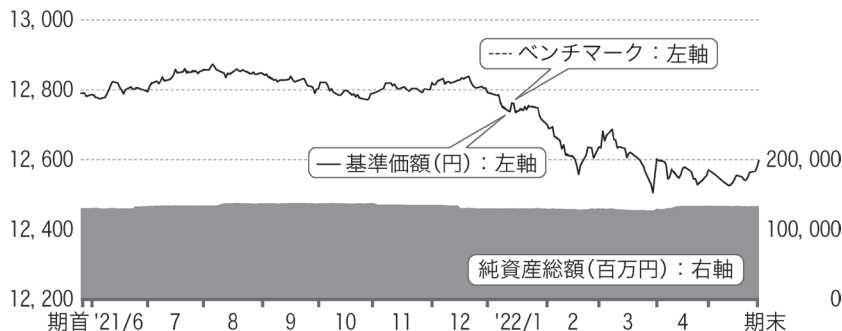
年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合)		公 社 債 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2021年5月25日	円 12,790	% -	386.73	% -	% 99.4
5月末	12,786	△0.0	386.62	△0.0	99.5
6月末	12,794	0.0	386.90	0.0	99.5
7月末	12,857	0.5	388.81	0.5	99.5
8月末	12,847	0.4	388.46	0.4	99.3
9月末	12,804	0.1	387.12	0.1	99.6
10月末	12,789	△0.0	386.72	△0.0	97.6
11月末	12,821	0.2	387.65	0.2	99.3
12月末	12,792	0.0	386.84	0.0	99.5
2022年1月末	12,701	△0.7	384.06	△0.7	99.4
2月末	12,637	△1.2	382.13	△1.2	99.3
3月末	12,602	△1.5	381.04	△1.5	99.6
4月末	12,571	△1.7	380.12	△1.7	99.5
(期 末) 2022年5月25日	12,598	△1.5	380.92	△1.5	99.4

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について (2021年5月26日から2022年5月25日まで)

基準価額等の推移



期首	12,790円
期末	12,598円
騰落率	-1.5%

※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、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 (2021年5月26日から2022年5月25日まで)

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

下落要因

- ・ 欧米中央銀行のタカ派（インフレ抑制を重視する立場）姿勢が強まったことによる海外金利の上昇に追随し、国内金利が上昇（債券価格は下落）したこと
- ・ 商品市況の高騰や円安による物価上昇を受け、日銀による緩和政策が修正されるとの思惑から国内金利が上昇したこと

▶ 投資環境について (2021年5月26日から2022年5月25日まで)

日本の長期金利の代表とされる10年国債利回りは上昇しました。

長期金利は、期初からしばらく低水準で推移しました。9月には、自民党の総裁選に向けて新政権に対する政策期待の高まりから株価の上昇が進んだことに加え、欧米債券市場で中央銀行による金融政策の正常化を見込んだ金利上昇が続いたことから、国内でも長期金利が上昇しました。

11月から12月にかけては、新たな変異ウイルス（オミクロン型）の感染拡大による景気への悪影響が懸念され、金利は低下する局面がありました。しかし、インフレの長期化懸念を背景に欧米中央銀行のタカ派姿勢が強まる中、欧米の長期金利が上昇基調で推移したことや、日銀が緩和修正を検討しているとの観測報道を受け、長期金利は上昇しました。

その後、2月に日銀が指値オペ（日銀が指定する利回りで国債を無制限に買い入れるオペ）の実施を通じて長期金利の上昇を止める姿勢を示したことや、ロシアによるウクライナ侵攻が景気の先行き不透明感を高めたことから、長期金利は低下しました。しかし、地政学リスクの高まりを受け商品市況が上昇しインフレ懸念が強まる中、欧米の中央銀行による利上げペースが速まるとの観測や日銀による緩和政策の修正が意識され、長期金利は上昇しました。

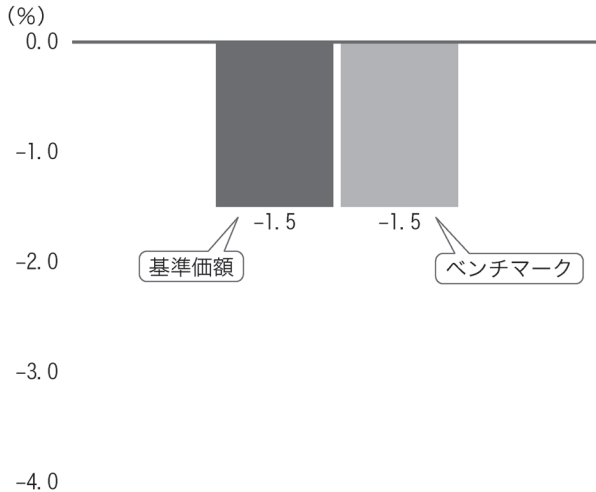
4月の日銀金融政策決定会合では、緩和政策維持と共に指値オペの原則毎営業日実施が決定されたことから、長期金利の上昇は一服しました。

▶ ポートフォリオについて (2021年5月26日から2022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 (2021年5月26日から2022年5月25日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は-1.5%となり、ベンチマークの騰落率-1.5%に連動した運用成果となりました。

2 今後の運用方針

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

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 (2021年5月26日から2022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12,743円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年5月26日から2022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	42,244,037	37,395,459
	地方債証券	3,582,405	2,005,578
	特殊債証券	464,252	1,804,130 (289,384)
	社債証券	2,500,000	1,304,818 (100,000)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※()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。

※社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年5月26日から2022年5月25日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 48,790	百万円 2,070	% 4.2	百万円 42,509	百万円 2,345	% 5.5

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	期末保有額
公社債	百万円 -	百万円 -	百万円 101

国内債券パッシブ・マザーファンド

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 1,500

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年5月26日から2022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(2022年5月25日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	102,407,000 (40,965,000)	107,584,329 (40,211,051)	80.8 (30.2)	— (—)	53.3 (17.0)	20.0 (9.0)	7.5 (4.2)
地 方 債 証 券	9,500,000 (9,500,000)	9,972,863 (9,972,863)	7.5 (7.5)	— (—)	3.3 (3.3)	2.2 (2.2)	2.0 (2.0)
特 殊 債 券 (除く金融債券)	8,658,615 (8,658,615)	9,345,255 (9,345,255)	7.0 (7.0)	— (—)	4.8 (4.8)	1.4 (1.4)	0.8 (0.8)
普 通 社 債 券	5,300,000 (5,300,000)	5,391,065 (5,391,065)	4.1 (4.1)	— (—)	2.6 (2.6)	1.1 (1.1)	0.4 (0.4)
合 計	125,865,615 (64,423,615)	132,293,514 (64,920,236)	99.4 (48.8)	— (—)	64.0 (27.7)	24.8 (13.7)	10.6 (7.3)

※()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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

国内債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 国内(邦貨建)公社債

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	138 5年国債	0.1000	570,000	571,653	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	703,000	710,564	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	1,020,000	1,051,824	2023/12/20
	432 2年国債	0.0050	610,000	610,878	2024/01/01
	433 2年国債	0.0050	330,000	330,471	2024/02/01
	434 2年国債	0.0050	1,130,000	1,131,695	2024/03/01
	139 5年国債	0.1000	260,000	260,826	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	815,000	825,000	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	1,020,000	1,060,351	2024/03/20
	435 2年国債	0.0050	3,480,000	3,485,463	2024/04/01
	140 5年国債	0.1000	600,000	602,112	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	315,000	319,369	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	780,000	819,904	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	795,000	798,044	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	90,000	91,181	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	753,000	790,883	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	760,000	763,222	2024/12/20
	336 10年国債	0.5000	340,000	344,943	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	120,000	121,126	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	664,000	701,004	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	770,000	773,472	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	805,000	815,440	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	490,000	519,855	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	980,000	984,664	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	785,000	795,974	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	590,000	625,453	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	1,080,000	1,085,378	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	770,000	781,519	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	620,000	664,336	2025/09/20
	146 5年国債	0.1000	1,550,000	1,558,029	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	557,000	563,867	2025/12/20
	84 20年国債	2.0000	500,000	536,560	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	1,540,000	1,542,648	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	350,000	351,872	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	645,000	697,754	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	1,070,000	1,071,733	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	310,000	311,705	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	742,000	812,586	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	20,000	21,821	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	1,240,000	1,241,872	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	811,000	815,557	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	580,000	635,952	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	2,140,000	2,142,931	2026/12/20

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
	345 10年国債	0.1000	258,000	259,473	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	424,000	465,221	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	540,000	542,991	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	632,000	693,379	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	280,000	281,489	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	305,000	340,639	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	625,000	628,156	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	677,000	756,039	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	610,000	612,885	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	153,000	170,752	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	590,000	592,395	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	207,000	233,079	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	355,000	403,848	2028/03/20
	351 10年国債	0.1000	390,000	391,415	2028/06/20
	102 20年国債	2.4000	457,000	522,446	2028/06/20
	352 10年国債	0.1000	390,000	391,228	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	390,000	440,508	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	370,000	420,253	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	430,000	431,122	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	378,000	428,599	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	390,000	437,100	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	415,000	415,842	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	140,000	157,432	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	700,000	700,735	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	386,000	443,514	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	940,000	940,000	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	227,000	260,087	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	910,000	908,971	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	263,000	302,402	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	510,000	599,627	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	1,130,000	1,127,807	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	100,000	116,152	2030/03/20
	359 10年国債	0.1000	1,210,000	1,206,612	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	200,000	229,954	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	295,000	334,468	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	200,000	223,564	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	1,120,000	1,115,856	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	55,000	62,987	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	330,000	375,206	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	340,000	418,710	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	1,310,000	1,303,345	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	80,000	93,199	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	190,000	219,740	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	1,150,000	1,142,502	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	205,000	241,252	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	180,000	208,702	2031/03/20

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
	127 20年国債	1. 9000	145, 000	166, 861	2031/03/20
	5 30年国債	2. 2000	290, 000	342, 089	2031/05/20
	363 10年国債	0. 1000	800, 000	793, 928	2031/06/20
	128 20年国債	1. 9000	65, 000	75, 008	2031/06/20
	364 10年国債	0. 1000	950, 000	941, 735	2031/09/20
	130 20年国債	1. 8000	155, 000	178, 017	2031/09/20
	131 20年国債	1. 7000	380, 000	432, 945	2031/09/20
	365 10年国債	0. 1000	1, 060, 000	1, 050, 036	2031/12/20
	132 20年国債	1. 7000	450, 000	513, 864	2031/12/20
	133 20年国債	1. 8000	190, 000	218, 750	2031/12/20
	366 10年国債	0. 2000	630, 000	629, 691	2032/03/20
	134 20年国債	1. 8000	200, 000	230, 918	2032/03/20
	135 20年国債	1. 7000	155, 000	177, 468	2032/03/20
	136 20年国債	1. 6000	120, 000	136, 239	2032/03/20
	7 30年国債	2. 3000	474, 000	571, 430	2032/05/20
	137 20年国債	1. 7000	185, 000	212, 178	2032/06/20
	139 20年国債	1. 6000	60, 000	68, 223	2032/06/20
	140 20年国債	1. 7000	340, 000	390, 581	2032/09/20
	9 30年国債	1. 4000	240, 000	268, 560	2032/12/20
	142 20年国債	1. 8000	190, 000	220, 553	2032/12/20
	10 30年国債	1. 1000	465, 000	506, 092	2033/03/20
	143 20年国債	1. 6000	120, 000	136, 988	2033/03/20
	144 20年国債	1. 5000	170, 000	192, 278	2033/03/20
	11 30年国債	1. 7000	430, 000	496, 349	2033/06/20
	145 20年国債	1. 7000	110, 000	126, 973	2033/06/20
	12 30年国債	2. 1000	570, 000	684, 581	2033/09/20
	146 20年国債	1. 7000	95, 000	109, 861	2033/09/20
	147 20年国債	1. 6000	210, 000	240, 794	2033/12/20
	14 30年国債	2. 4000	622, 000	771, 497	2034/03/20
	148 20年国債	1. 5000	219, 000	248, 847	2034/03/20
	149 20年国債	1. 5000	525, 000	596, 982	2034/06/20
	16 30年国債	2. 5000	465, 000	585, 156	2034/09/20
	150 20年国債	1. 4000	391, 000	440, 269	2034/09/20
	151 20年国債	1. 2000	550, 000	606, 287	2034/12/20
	18 30年国債	2. 3000	540, 000	669, 983	2035/03/20
	152 20年国債	1. 2000	545, 000	601, 080	2035/03/20
	19 30年国債	2. 3000	470, 000	584, 529	2035/06/20
	153 20年国債	1. 3000	437, 000	487, 661	2035/06/20
	154 20年国債	1. 2000	380, 000	419, 504	2035/09/20
	21 30年国債	2. 3000	345, 000	431, 032	2035/12/20
	155 20年国債	1. 0000	410, 000	441, 947	2035/12/20
	22 30年国債	2. 5000	315, 000	402, 661	2036/03/20
	156 20年国債	0. 4000	480, 000	478, 430	2036/03/20
	23 30年国債	2. 5000	329, 000	421, 580	2036/06/20
	157 20年国債	0. 2000	335, 000	324, 132	2036/06/20
	24 30年国債	2. 5000	310, 000	398, 173	2036/09/20

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
	158 20年国債	0.5000	410,000	413,034	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	290,000	365,104	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	388,000	395,686	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	363,000	462,926	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	355,000	366,562	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	380,000	386,406	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	420,000	543,790	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	370,000	375,531	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	430,000	435,581	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	386,000	501,726	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	385,000	383,590	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	390,000	387,691	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	177,000	228,087	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	335,000	342,782	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	380,000	376,257	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	442,000	564,098	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	370,000	359,517	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	400,000	381,124	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	325,000	410,124	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	385,000	365,726	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	365,000	345,669	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	360,000	461,102	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	480,000	461,203	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	505,000	484,194	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	368,000	453,788	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	510,000	487,927	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	515,000	500,126	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	457,000	579,645	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	550,000	532,592	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	540,000	512,314	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	350,000	432,586	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	500,000	482,570	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	560,000	539,789	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	90,000	111,525	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	110,000	111,914	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	405,000	494,978	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	410,000	493,734	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	180,000	220,467	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	270,000	325,398	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	270,000	320,298	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	280,000	332,362	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	285,000	338,505	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	280,000	332,766	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	355,000	407,177	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	315,000	361,377	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	330,000	385,539	2045/06/20

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
	48 30年国債	1.4000	335,000	377,096	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	315,000	354,589	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	295,000	293,530	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	315,000	278,712	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	313,000	289,750	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	307,000	290,514	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	75,000	74,155	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	325,000	320,976	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	500,000	493,245	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	355,000	349,433	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	40,000	54,040	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	340,000	333,924	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	340,000	325,298	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	330,000	330,349	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	335,000	318,923	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	242,000	316,107	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	165,000	148,811	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	220,000	192,495	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	305,000	266,014	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	305,000	266,024	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	185,000	242,825	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	310,000	270,106	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	350,000	321,072	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	350,000	320,869	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	440,000	414,348	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	247,000	325,689	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	350,000	329,087	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	320,000	300,406	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	380,000	356,170	2051/09/20
	73 30年国債	0.7000	410,000	383,678	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	235,000	298,222	2052/03/20
	74 30年国債	1.0000	70,000	70,730	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	240,000	299,707	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	265,000	317,827	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	300,000	335,451	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	503,000	418,274	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	450,000	437,809	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	370,000	348,188	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	380,000	321,092	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	475,000	398,881	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	545,000	489,023	2061/03/20
	小 計	-	102,407,000	107,584,329	-
地方債証券	24-2 北九州市債	0.7150	100,000	100,408	2022/12/26
	118 共同発行地方	0.8400	100,000	100,548	2023/01/25
	47 横浜市5年	0.0400	100,000	100,010	2023/01/27
	24-14 北海道公債	0.8000	100,000	100,588	2023/02/28

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
	29-12 京都府5年	0.0400	300,000	300,031	2023/03/16
	29-11 福岡市5年	0.0400	300,000	300,031	2023/03/16
	29-5 京都市5年	0.0400	100,000	100,010	2023/03/28
	1 東京都20年	1.5400	100,000	101,634	2023/06/20
	373 大阪府公債	0.9040	100,000	100,955	2023/06/27
	377 大阪府公債	0.7290	100,000	100,982	2023/10/30
	25-8 千葉県公債	0.6700	100,000	100,944	2023/11/24
	727 東京都公債	0.7200	500,000	505,335	2023/12/20
	1 名古屋市20年	1.9900	200,000	206,126	2023/12/20
	25-11 福岡県公債	0.6940	100,000	101,114	2024/02/26
	1-1 大阪市5年	0.0100	300,000	299,652	2024/05/21
	1 神奈川県20年	2.5500	100,000	105,144	2024/06/20
	26-4 札幌市公債	0.5400	100,000	100,980	2024/06/20
	26-3 横浜市公債	0.5710	200,000	202,255	2024/08/19
	137 共同発行地方	0.5660	200,000	202,235	2024/08/23
	26-3 福岡県公債	0.5620	100,000	101,119	2024/08/27
	1-6 京都府5年	0.0010	200,000	199,707	2024/09/19
	138 共同発行地方	0.5540	200,000	202,286	2024/09/25
	1-2 北九州市5年	0.0010	100,000	99,855	2024/09/26
	388 大阪府公債	0.5400	100,000	101,103	2024/09/27
	26-17 神戸市公債	0.2800	100,000	100,571	2025/01/27
	26-10 福岡県公債	0.4530	100,000	101,057	2025/02/26
	26-15 北海道公債	0.4340	100,000	100,986	2025/02/27
	6 東京都20年	2.0000	100,000	105,422	2025/03/19
	4 横浜市20年	2.0300	100,000	105,512	2025/03/19
	27-4 京都府公債	0.5530	100,000	101,481	2025/06/19
	3 神奈川県20年	2.1100	100,000	106,258	2025/06/20
	3 名古屋市20年	2.0300	100,000	106,009	2025/06/20
	1 静岡県20年	2.1800	100,000	106,965	2025/09/19
	27-16 愛知県公債	0.4540	400,000	405,393	2025/12/25
	9 横浜市20年	2.3500	100,000	109,200	2026/06/19
	5 名古屋市20年	2.3000	100,000	109,524	2026/09/18
	7 神奈川県20年	2.2200	100,000	110,241	2027/03/19
	172 共同発行地方	0.2250	500,000	503,183	2027/07/23
	14 横浜市20年	2.3200	100,000	112,572	2028/03/17
	5 兵庫県公債15年	1.3100	300,000	320,371	2028/05/26
	183 共同発行地方	0.2050	600,000	601,589	2028/06/23
	7 京都市20年	2.3800	100,000	113,881	2028/09/21
	30-18 北海道公債	0.1460	200,000	199,013	2029/02/28
	792 東京都公債	0.0500	300,000	297,053	2029/03/19
	1-1 福岡県公債	0.0290	200,000	197,311	2029/06/21
	13 神奈川県20年	2.2100	100,000	114,813	2029/12/20
	10兵庫県公債20年	2.2400	100,000	115,160	2030/02/22
	22-8 愛知県20年	1.8910	200,000	226,673	2030/09/13
	1 東京都30年	2.2100	100,000	120,041	2033/06/20
	1 京都市30年	2.5700	100,000	129,599	2037/09/18

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	8 東京都30年	2.2300	400,000	500,466	2038/09/17
	13 東京都30年	1.9300	500,000	609,464	2042/03/19
	7 静岡県30年	1.9880	100,000	123,280	2043/06/19
	1-3 福岡県30年	0.4320	100,000	86,697	2049/06/18
	小 計	-	9,500,000	9,972,863	-
特 殊 債 券 (除く金融債券)	45 地方公共団体	0.7910	200,000	201,176	2023/02/28
	104 道路機構	0.7150	400,000	402,273	2023/03/20
	3 公営企業20年	1.0300	100,000	100,827	2023/03/22
	5 公営企業20年	2.1100	100,000	102,744	2023/09/20
	3 政保政策投資CO	2.1000	200,000	206,701	2023/12/18
	61 地方公共団体	0.6900	100,000	101,311	2024/06/28
	62 地方公共団体	0.6310	400,000	404,939	2024/07/26
	63 地方公共団体	0.5810	100,000	101,168	2024/08/28
	227 政保道路機構	0.5440	200,000	202,643	2024/09/30
	231 政保道路機構	0.4950	300,000	303,879	2024/11/29
	67政保地方公共団	0.4660	100,000	101,233	2024/12/13
	85 中日本高速道	0.0700	300,000	299,680	2025/10/21
	17 公営企業20年	2.3900	100,000	108,788	2026/03/24
	288 政保道路機構	0.0100	189,000	188,901	2026/09/30
	20 公営企業20年	2.2500	100,000	110,345	2027/03/24
	36 日本政策投資B	2.2300	100,000	110,597	2027/05/28
	22 公営企業20年	2.3200	100,000	111,161	2027/06/18
	27 道路機構	2.3400	100,000	111,826	2027/10/20
	101 地方公共団体	0.2350	100,000	100,549	2027/10/28
	226 住宅支援機構	0.2400	100,000	100,486	2027/12/20
	106 地方公共団体	0.2150	200,000	200,548	2028/03/28
	24 公営企業20年	2.2900	200,000	224,932	2028/04/25
	37 道路機構	2.4200	300,000	340,296	2028/06/20
	47 道路機構	2.4100	200,000	229,558	2029/04/20
	79 政保道路機構	2.1000	200,000	227,173	2029/04/27
	2 地方公営20年	2.2900	100,000	114,099	2029/04/27
	81 政保道路機構	2.1000	200,000	227,426	2029/05/31
	90 政保道路機構	2.1000	500,000	571,183	2029/09/28
	99 政保道路機構	2.2000	100,000	115,553	2030/01/31
	52 住宅支援機構	2.0100	100,000	113,875	2030/07/16
	9 道路債券	2.9000	100,000	125,464	2032/05/20
	176 政保道路機構	1.6450	100,000	113,833	2032/10/29
	130 住宅支援機構	1.7630	200,000	229,162	2032/12/20
	196 政保道路機構	1.7790	100,000	115,730	2033/07/29
	210 政保道路機構	1.5470	200,000	227,066	2034/01/31
	S9 住宅金融RMBS	2.1900	20,388	20,534	2037/05/10
	S10住宅金融RMBS	2.1500	31,533	31,741	2037/05/10
	S3 住宅機構RMBS	2.0900	11,012	11,172	2037/11/10
	S5 住宅機構RMBS	1.9600	23,430	23,907	2038/11/10
	S7 住宅機構RMBS	2.0000	12,091	12,332	2038/11/10
	S9 住宅機構RMBS	2.2400	12,268	12,605	2039/05/10

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
	88 政保道路機構	2.3000	100,000	127,195	2039/08/31
	S10 住宅機構RMBS	2.0900	12,070	12,328	2039/11/10
	29 住宅金融RMBS	1.8100	9,976	10,028	2040/04/10
	S11 住宅機構RMBS	2.1200	12,907	13,300	2040/05/10
	32 住宅金融RMBS	1.6900	10,991	11,109	2040/07/10
	35 住宅金融RMBS	1.7900	11,739	11,944	2040/10/10
	39 住宅金融RMBS	1.8400	10,670	10,800	2041/02/10
	41 住宅金融RMBS	2.0900	11,443	11,685	2041/04/10
	43 住宅金融RMBS	2.2800	21,842	22,193	2041/06/10
	51 住宅金融RMBS	2.2100	10,410	10,478	2042/02/10
	53 住宅金融RMBS	2.0900	11,196	11,427	2042/04/10
	1 住宅機構RMBS	2.1300	20,490	20,625	2042/05/10
	2 住宅機構RMBS	2.1900	23,098	23,643	2042/06/10
	4 住宅機構RMBS	2.2900	10,702	10,874	2042/08/10
	6 住宅機構RMBS	2.1300	10,622	10,779	2042/10/10
	19 住宅機構RMBS	2.1500	15,756	16,518	2043/11/10
	24 住宅機構RMBS	2.3400	32,138	33,879	2044/05/10
	26 住宅機構RMBS	2.1400	50,133	52,684	2044/07/10
	27 住宅機構RMBS	2.0500	17,865	18,818	2044/08/10
	28 住宅機構RMBS	1.9800	19,816	20,993	2044/09/10
	29 住宅機構RMBS	1.9500	21,818	23,192	2044/10/10
	30 住宅機構RMBS	1.9700	21,714	23,103	2044/11/10
	32 住宅機構RMBS	1.8200	42,564	44,947	2045/01/10
	35 住宅機構RMBS	1.8700	21,558	22,791	2045/04/10
	36 住宅機構RMBS	1.8100	20,992	22,127	2045/05/10
	43 住宅機構RMBS	1.6000	26,600	28,068	2045/12/10
	46 住宅機構RMBS	1.8500	21,015	22,164	2046/03/10
	48 住宅機構RMBS	1.8900	39,662	41,732	2046/05/10
	49 住宅機構RMBS	1.7600	20,176	21,152	2046/06/10
	51 住宅機構RMBS	1.6400	44,622	46,754	2046/08/10
	55 住宅機構RMBS	1.4100	59,176	61,880	2046/12/10
	18 道路機構	2.8700	100,000	142,118	2046/12/20
	57 住宅機構RMBS	1.4400	28,630	29,938	2047/02/10
	58 住宅機構RMBS	1.4000	32,224	33,703	2047/03/10
	22 道路機構	2.6700	300,000	413,260	2047/03/20
	59 住宅機構RMBS	1.4400	61,884	64,767	2047/04/10
	60 住宅機構RMBS	1.3400	96,564	100,677	2047/05/10
	61 住宅機構RMBS	1.2600	32,571	33,860	2047/06/10
	67 住宅機構RMBS	1.0900	39,271	40,614	2047/12/10
	69 住宅機構RMBS	1.2800	80,184	83,623	2048/02/10
	70 住宅機構RMBS	1.2500	70,094	72,890	2048/03/10
	73 住宅機構RMBS	1.3000	39,865	41,615	2048/06/10
	99 住宅機構RMBS	0.8800	60,246	61,685	2050/08/10
	123 住宅機構RMBS	0.4600	78,273	77,803	2052/08/10
	124 住宅機構RMBS	0.4200	78,125	77,429	2052/09/10
	125 住宅機構RMBS	0.4200	78,131	77,443	2052/10/10
	127 住宅機構RMBS	0.4000	79,915	79,035	2052/12/10

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
	128 住宅機構RMBS	0.4200	79,103	78,359	2053/01/10
	129 住宅機構RMBS	0.4600	80,774	80,208	2053/02/10
	137 住宅機構RMBS	0.4700	83,408	82,740	2053/10/10
	167 住宅機構RMBS	0.4100	95,870	94,815	2056/04/10
	小 計	-	8,658,615	9,345,255	-
普通社債券	2 BPCE S.A.	0.6450	200,000	200,552	2023/07/12
	1 野村ホールディングス	0.3000	100,000	99,982	2023/09/04
	20 西日本高速道	0.7590	100,000	100,958	2023/09/20
	16 日立製作所	0.8130	100,000	101,185	2023/12/13
	23 西日本高速道	0.6020	100,000	101,110	2024/06/20
	1 みずほFG劣後	0.9500	100,000	100,993	2024/07/16
	1 三井住友FG劣後	0.8490	100,000	101,112	2024/09/12
	38 東京電力パワー	0.5800	100,000	100,426	2025/07/16
	64 阪急阪神HLDG	0.1000	100,000	99,606	2026/12/08
	73 ホンダファイナンス	0.1000	200,000	199,164	2026/12/18
	553 中部電力	0.2500	200,000	199,934	2027/02/25
	2 三菱HCキャピタル	0.1900	200,000	198,872	2027/03/01
	63 三井物産	2.3700	100,000	110,545	2027/04/23
	9 みずほ銀行劣後	2.5200	100,000	109,479	2027/04/27
	8 住友信託 劣後	2.4900	100,000	109,964	2027/05/10
	550 関西電力	0.3900	300,000	300,309	2027/05/25
	13 大和ハウス	0.2850	100,000	100,432	2027/06/01
	30 東レ	0.3750	100,000	100,655	2027/07/16
	8 みずほコーポレート	2.5400	100,000	111,330	2027/07/27
	56 住友化学	0.3800	200,000	201,013	2027/09/13
	38 京王電鉄	0.2950	100,000	100,430	2027/11/29
	17 NTTファイナンス	0.2800	200,000	200,065	2027/12/20
	22 パナソニック	0.2900	100,000	99,948	2027/12/24
	24三菱ケミカルホールデイ	0.3700	100,000	100,437	2028/02/25
	7 ファーストリテイリング	0.4050	100,000	100,808	2028/06/06
	9 TDK	0.2600	100,000	99,167	2028/12/01
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	112,459	2029/01/29
	42 東海旅客鉄道	2.3120	100,000	113,784	2029/04/24
	508 東北電力	0.4650	200,000	200,645	2029/04/25
	45 東京地下鉄	0.2150	100,000	98,843	2030/09/18
	41 大阪瓦斯	0.2200	200,000	197,175	2031/06/03
	135 三菱地所	0.2600	200,000	196,928	2031/06/20
	169 東日本旅客鉄	0.1650	200,000	196,084	2031/07/15
	546 中部電力	0.2800	200,000	195,464	2031/09/25
	496 九州電力	0.3300	300,000	293,094	2031/10/24
	10 東急	0.2400	100,000	98,285	2031/12/09
	58 三菱地所	2.9000	100,000	123,697	2032/05/20
	110東日本旅客鉄	1.7600	100,000	116,117	2045/07/28
	小 計	-	5,300,000	5,391,065	-
	合 計	-	125,865,615	132,293,514	-

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

国内債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2022年5月25日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	132,293,514	99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,352,780	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	133,646,295	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年5月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	133,646,295,101円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	409,266,526
公 社 債 (評 価 額)	132,293,514,434
未 収 入 金	621,844,500
未 収 利 息	317,386,327
前 払 費 用	4,283,314
(B) 負 債	551,359,982
未 払 金	300,000,000
未 払 解 約 金	251,359,000
そ の 他 未 払 費 用	982
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	133,094,935,119
元 本	105,645,341,665
次 期 繰 越 損 益 金	27,449,593,454
(D) 受 益 権 総 口 数	105,645,341,665口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	12,598円

※当期における期首元本額101,956,373,249円、期中追加設定元本額21,150,928,690円、期中一部解約元本額17,461,960,274円です。
 ※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

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

■ 損益の状況

(自2021年5月26日 至2022年5月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,242,577,931円
受 取 利 息	1,242,855,539
支 払 利 息	△ 277,608
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 3,207,493,428
売 買 益	35,039,460
売 買 損	△ 3,242,532,888
(C) そ の 他 費 用 等	△ 35,720
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 1,964,951,217
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	28,445,400,331
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 4,818,502,976
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,787,647,316
(H) 合 計 (D + E + F + G)	27,449,593,454
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	27,449,593,454

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 ※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 ※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

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)	6,953,069,272円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,227,982,687円
三井住友・DC年金バランス50 (標準型)	11,734,437,044円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,557,006,402円
三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)	2,703,723,303円	SMAM・バランスファンドVVL30<適格機関投資家限定>	309,590,723円
SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	797,833,407円	SMAM・バランスファンドVVL50<適格機関投資家限定>	549,149,417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)	44,403,217円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	253,204,817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)	185,681,575円	SMAM・バランスファンドVLI国際分散型<適格機関投資家限定>	121,177,817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)	487,268,958円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,830,653,508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)	785,602,463円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,124,463,694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)	405,833,469円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,361,344,648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)	529,267,974円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,303,725,157円
三井住友・DC年金バランスゼロ (債券型)	135,705,727円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	972,339円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	2,012,126,562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)	1,141,994,547円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	1,075,370,269円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	431,748,136円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	428,125,024円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	535,210,250円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	48,088,984円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	179,486,947円
三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型)	2,003,053,602円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	44,152,419円
三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型)	679,976,897円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,435,609,974円
三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型)	1,081,328,608円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,107,627,635円
三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型)	252,769,138円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	672,529,299円
三井住友・資産最適化ファンド (5成長重視型)	93,799,630円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	209,664,294円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	161,822,156円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	19,383,067円
三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型)	131,633,496円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	270,758,159円
三井住友DS・年金バランス50 (標準型)	242,913,295円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,090,057,787円
三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型)	74,257,131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>	1,242,289,961円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	6,051,232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>	1,060,656,073円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,397,382,658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>	1,356,801,416円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,842,882,387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>	5,913,693,014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19期（2021年8月26日から2022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。 ・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。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		（ベンチマーク） FTSE世界国債 インデックス （除く日本、円 ヘッジベース）		公社債 組入比率	純資産 総額
	騰落	率	騰落	率		
	円	%		%	%	百万円
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
18期(2021年8月25日)	15,251	△1.1	423.79	△1.2	98.4	26,330
19期(2022年8月25日)	13,216	△13.3	367.05	△13.4	100.9	26,492

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

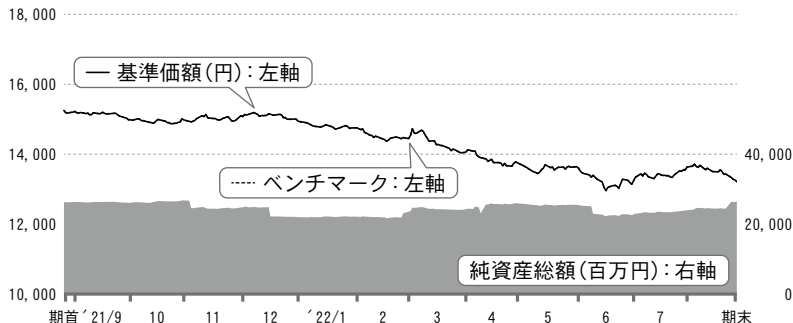
年月日	基準価額		（ベンチマーク） FTSE世界国債 インデックス （除く日本、円 ヘッジベース）		公社債 組入比率
	騰落	率	騰落	率	
(期首) 2021年8月25日	円	%		%	%
	15,251	—	423.79	—	98.4
8月末	15,226	△0.2	423.13	△0.2	98.3
9月末	14,987	△1.7	416.47	△1.7	99.0
10月末	14,981	△1.8	416.21	△1.8	101.1
11月末	15,076	△1.1	418.85	△1.2	96.8
12月末	14,942	△2.0	415.09	△2.1	99.9
2022年1月末	14,756	△3.2	409.98	△3.3	98.0
2月末	14,448	△5.3	401.33	△5.3	98.8
3月末	14,059	△7.8	390.67	△7.8	104.6
4月末	13,755	△9.8	382.14	△9.8	101.4
5月末	13,611	△10.8	378.13	△10.8	98.2
6月末	13,243	△13.2	367.91	△13.2	103.2
7月末	13,630	△10.6	378.91	△10.6	96.9
(期末) 2022年8月25日	13,216	△13.3	367.05	△13.4	100.9

※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（2021年8月26日から2022年8月25日まで）

基準価額等の推移



期首	15,251円
期末	13,216円
騰落率	-13.3%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

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

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2021年8月26日から2022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。

下落要因

- ・グローバルなインフレ懸念の高まりや、主要国の中銀による急速な金融引き締めへの警戒感から、米欧金利が上昇（債券価格は下落）したこと

▶ 投資環境について (2021年8月26日から2022年8月25日まで)

債券市場は米国、欧州ともに大幅に下落しました。

期を通じて、米国や欧州の長期金利（10年国債利回り）は大幅に上昇しました。グローバルにインフレ懸念が高まる中、主要国の中銀による急速な金融引き締めへの警戒感などから、米欧金利は上昇しました。

米国では、FRB（米連邦準備制度理事会）は、3月から利上げを開始したものの、その後も止まらない物価上昇を受けて金融引き締め姿勢を強め、大幅な利上げを継続しました。ECB（欧州中央銀行）もインフレ抑制姿勢を強め、7月から利上げを開始しました。

6月半ばから8月初旬にかけて、急速な金融引き締め観測による景気悪化懸念から、米欧の長期金利は上昇幅を縮小する局面もありましたが、インフレ加速への懸念が根強く、期末にかけて再び上昇に転じました。

▶ ポートフォリオについて (2021年8月26日から2022年8月25日まで)

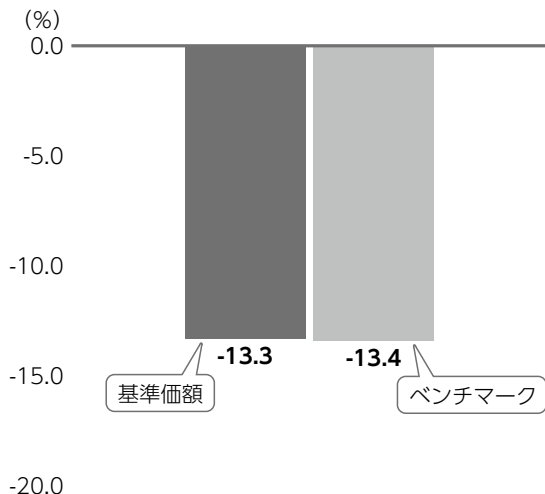
債券組入比率

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。インデックス構成銘柄の変更が実施される毎月末において、ファンドの特性値（通貨・国別配分、満期構成、デュレーション（投資資金の平均回収期間：金利の変動による債券価格の感応度）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（2021年8月26日から2022年8月25日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドはF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）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-13.3%となり、ベンチマークの騰落率-13.4%に概ね連動する結果となりました。

2 今後の運用方針

米国では、F R Bが景気よりもインフレ抑制を優先し、引き続き積極的な金融引き締めを行うと見込まれ、金利に上昇圧力が残る見通しです。一方で、急速な金融引き締めによる景気後退懸念も意識されるため、長期金利の上昇余地は限定的になると予想します。ユーロ圏でも、E C Bのインフレ抑制重視は変わらず、利上げ加速観測はくすぶりやすく、金利に押上げ圧力が残存する見通しです。一方で、利上げに伴う景気減速や域内の天然ガス供給を巡る不透明感が強いことから、長期金利の上昇余地は限定的になると予想します。

上記見通しのもと、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、迅速なりバランスを行います。

なお、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 (2021年8月26日から2022年8月25日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) そ の 他 費 用	9円	0.066%	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)	(9)	(0.065)	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)	(0)	(0.001)	そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	9	0.066	

期中の平均基準価額は14,307円です。

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

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年8月26日から2022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	千アメリカ・ドル 64,404	千アメリカ・ドル 57,939	
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 3,808	千カナダ・ドル 3,663	
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 2,358	千オーストラリア・ドル 3,258	
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 1,718	千シンガポール・ドル 1,735	
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 4,568	千イギリス・ポンド 5,426	
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シェケル 1,237	千イスラエル・シェケル 1,747	
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 2,795	千デンマーク・クローネ 4,058	
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 2,315	千ノルウェー・クローネ 2,865	
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 2,745	千スウェーデン・クローナ 2,922	
	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 16,943	千メキシコ・ペソ 16,455	
国	中 国	国 債 証 券	千オフショア・人民元 38,448	千オフショア・人民元 4,037	
	ポーランド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 6,668	千ポーランド・ズロチ 7,128	
	ユ ー ロ	国 債 証 券	千ユーロ 539	千ユーロ 695	
	アイルランド	国 債 証 券	1,832	1,851	
	オランダ	国 債 証 券	1,931	2,216	
	ベルギー	国 債 証 券	9,797	10,326	
	フランス	国 債 証 券	7,539	7,945	
	ドイツ	国 債 証 券	5,718	6,052	
	スペイン	国 債 証 券	9,011	10,058	
	イタリア	国 債 証 券	542	637	
フィンランド	国 債 証 券	1,393	1,489		
オーストリア	国 債 証 券				

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

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 (2021年8月26日から2022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 (2021年8月26日から2022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 (2022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	額面金額	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		
		外貨建金額	評価額 邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
			千円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	—	22.7	18.2	11.1
	109,430	100,540	13,772,103	52.0	—	—	—	—
カ ナ ダ	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル			—	1.1	0.6	0.5
	5,910	5,448	576,083	2.2	—	—	—	—
オーストラリア	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル			—	1.1	0.4	0.0
	4,860	4,407	418,101	1.6	—	—	—	—
シンガポール	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル			—	0.6	0.3	0.0
	2,690	2,619	257,749	1.0	—	—	—	—
イギリス	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド			—	3.6	0.8	0.4
	8,310	7,899	1,278,192	4.8	—	—	—	—
イスラエル	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル			—	0.2	0.1	0.1
	2,700	2,678	112,184	0.4	—	—	—	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ			—	0.3	0.1	0.0
	5,290	5,373	98,816	0.4	—	—	—	—
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ			—	0.1	0.1	0.0
	4,290	3,957	56,002	0.2	—	—	—	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ			—	0.1	0.1	0.0
	5,420	5,312	68,695	0.3	—	—	—	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ			—	0.4	0.3	0.1
	33,220	31,300	215,517	0.8	—	—	—	—
中 国	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元			—	1.4	0.6	0.6
	34,000	34,759	693,582	2.6	—	—	—	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ			—	0.1	0.3	—
	4,690	3,894	111,670	0.4	—	—	—	—
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
アイルランド	1,340	1,260	172,355	0.7	—	0.5	0.1	0.0
オランダ	3,150	3,140	429,478	1.6	—	1.1	0.4	0.2
ベルギー	3,815	3,771	515,747	1.9	—	1.4	0.4	0.1
フランス	17,180	17,012	2,326,395	8.8	—	5.5	2.6	0.7
ドイツ	12,540	12,743	1,742,621	6.6	—	3.7	1.7	1.1
スペイン	9,970	9,898	1,353,675	5.1	—	3.1	1.5	0.5
イタリア	15,840	15,152	2,072,171	7.8	—	4.4	2.3	1.1
フィンランド	1,100	1,020	139,590	0.5	—	0.4	0.1	0.0
オーストリア	2,470	2,393	327,283	1.2	—	0.7	0.4	0.1
合 計	—	—	26,738,023	100.9	—	52.4	31.6	17.0

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

ヘッジ付き外国債券バッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示 外国(外貨建)公社債

区 分	銘 柄	種 類	期 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	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250%	千アメリカ・ドル 190	千アメリカ・ドル 176	千円 24,159	2043/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	300	297	40,791	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	900	893	122,433	2023/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	290	258	35,360	2043/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	230	230	31,635	2043/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	900	887	121,557	2024/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	300	289	39,591	2044/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	270	265	36,305	2024/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	270	270	37,085	2044/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	380	350	48,042	2044/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	500	488	66,905	2024/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	660	638	87,461	2025/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	220	198	27,171	2044/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	220	181	24,831	2045/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	570	550	75,467	2025/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	290	261	35,819	2045/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	600	576	78,941	2025/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	110	97	13,287	2045/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	300	270	37,048	2045/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	600	565	77,496	2026/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	150	123	16,878	2046/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	570	535	73,414	2026/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	230	188	25,888	2046/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	550	513	70,270	2026/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	300	294	40,315	2023/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	250	195	26,716	2046/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	750	735	100,792	2023/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	880	834	114,359	2026/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	340	300	41,122	2046/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	550	541	74,232	2023/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	450	430	58,989	2027/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	460	452	62,040	2024/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	120	108	14,859	2047/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	280	274	37,629	2024/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	200	195	26,796	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	840	807	110,590	2027/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	300	271	37,176	2047/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	500	488	66,879	2024/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	600	585	80,222	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	410	400	54,889	2024/07/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	570	544	74,525	2027/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	210	181	24,875	2047/08/15	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	300	291	39,921	2024/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	580	566	77,579	2024/10/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	250	216	29,645	2047/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	300	285	39,128	2027/11/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	500	487	66,745	2024/12/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	400	391	53,659	2025/01/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	420	409	56,093	2028/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	400	364	49,937	2048/02/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	500	492	67,451	2025/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	500	490	67,232	2025/03/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	200	197	27,025	2025/04/30	
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	500	490	67,135	2028/05/15	

ヘッジ付き外国債券バッシュ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	420	393	53,859	2048/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	600	591	81,051	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	490	481	65,918	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	660	646	88,576	2028/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	510	467	64,013	2048/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	600	588	80,672	2025/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	620	613	84,057	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	380	377	51,698	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	450	443	60,759	2048/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	900	894	122,549	2023/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	450	444	60,894	2024/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	390	384	52,628	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	510	498	68,304	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	430	420	57,531	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	520	501	68,730	2029/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	370	342	46,849	2049/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	420	404	55,407	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	420	412	56,500	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	400	386	53,000	2026/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	600	569	78,007	2029/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	410	370	50,769	2049/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	320	306	41,979	2026/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	400	388	53,233	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	750	711	97,449	2026/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,130	1,096	150,204	2024/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	420	380	52,106	2029/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	460	365	50,063	2049/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	470	436	59,738	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	450	431	59,141	2024/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	480	449	61,584	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	330	301	41,293	2029/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	480	392	53,781	2049/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	650	607	83,186	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	510	489	67,032	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	570	508	69,696	2030/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	470	352	48,269	2050/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	280	254	34,902	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	420	389	53,414	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	520	461	63,274	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	300	281	38,568	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	350	324	44,459	2027/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	430	409	56,153	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	390	375	51,477	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	870	722	98,940	2030/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	530	324	44,415	2050/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	370	339	46,516	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	270	183	25,149	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	370	325	44,576	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	320	295	40,467	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	480	422	57,929	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	650	594	81,496	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	710	622	85,322	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	650	566	77,573	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	1,050	867	118,792	2030/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	680	430	58,980	2050/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	750	727	99,652	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	380	256	35,098	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	640	559	76,643	2027/08/31

ヘッジ付き外国債券バッシュ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	590	536	73,556	2025/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	290	263	36,096	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	470	407	55,751	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	1,090	1,052	144,104	2023/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	570	551	75,528	2023/09/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	1,100	925	126,757	2030/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	720	488	66,849	2050/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,040	890	122,024	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	730	527	72,324	2051/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	330	297	40,816	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	710	622	85,242	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	350	317	43,506	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	620	561	76,859	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	580	506	69,429	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	350	305	41,798	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	650	581	79,646	2028/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	530	372	50,961	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	410	314	43,029	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	940	850	116,518	2026/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	780	678	92,937	2027/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	420	380	52,121	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	500	481	65,985	2023/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	600	573	78,601	2024/01/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	1,050	1,001	137,192	2024/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	890	848	116,201	2024/03/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	720	656	89,984	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	660	593	81,259	2028/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	930	826	113,277	2031/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	820	669	91,675	2051/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	730	654	89,620	2028/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	740	603	82,667	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	620	586	80,335	2024/06/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	500	455	62,406	2026/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	480	429	58,774	2028/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	580	519	71,142	2028/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	530	502	68,838	2024/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	1,320	1,130	154,834	2031/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	490	433	59,385	2028/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	680	506	69,313	2051/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	640	475	65,154	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	720	648	88,854	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	650	571	78,324	2028/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	410	386	52,984	2024/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	160	144	19,815	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	700	658	90,259	2024/09/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	560	498	68,300	2028/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	340	308	42,237	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	230	217	29,731	2024/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	670	483	66,186	2051/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,010	869	119,157	2031/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	200	193	26,437	2023/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	660	623	85,349	2024/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	500	457	62,689	2026/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	400	367	50,371	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	180	161	22,082	2028/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	590	458	62,766	2041/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	600	568	77,873	2024/12/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	900	811	111,136	2028/11/30

ヘッジ付き外国債券バッシブ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	980	946	129,630	2023/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	900	868	119,015	2024/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	660	626	85,751	2025/01/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	730	669	91,772	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	720	644	88,331	2028/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,220	1,096	150,246	2032/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	260	248	34,017	2025/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	540	494	67,721	2029/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	530	438	60,115	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	670	530	72,639	2052/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	850	784	107,445	2029/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	200	188	25,821	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,060	1,041	142,691	2024/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	290	275	37,708	2029/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	310	300	41,104	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	570	561	76,976	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,000	979	134,223	2032/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	320	314	43,095	2025/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	290	283	38,862	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	250	238	32,707	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	700	639	87,570	2052/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	430	417	57,196	2029/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	600	596	81,664	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,080	1,068	146,325	2025/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	280	280	38,376	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	830	832	114,057	2029/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	630	600	82,200	2024/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	520	491	67,392	2024/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	5.2500	200	222	30,460	2028/11/15
	US TREASURY BOND	国債証券	5.3750	80	93	12,774	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	100	115	15,872	2036/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	40	45	6,274	2038/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	180	185	25,372	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	170	191	26,197	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	120	139	19,044	2039/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	150	170	23,394	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	100	117	16,071	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	140	159	21,781	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	340	360	49,436	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	140	155	21,348	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	620	700	95,901	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	210	197	27,107	2041/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	150	140	19,310	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	290	266	36,483	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	440	385	52,760	2042/11/15
小計			—	109,430	100,540	13,772,103	—
カナダ	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	90	104	11,049	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	10	12	1,306	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.0000	100	121	12,895	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0000	140	157	16,641	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	90	96	10,153	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	440	432	45,756	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	160	155	16,421	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	140	132	13,958	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	170	159	16,863	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	140	126	13,387	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	400	318	33,631	2051/12/01

ヘッジ付き外国債券バッシュ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	期 末				
			利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	80	78	8,320	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	60	56	5,966	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	150	142	15,057	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	140	137	14,530	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	230	221	23,401	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	440	384	40,684	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	250	236	25,051	2025/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	270	247	26,198	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	340	276	29,199	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	270	242	25,655	2026/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	460	437	46,210	2024/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	350	307	32,516	2031/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	150	145	15,371	2023/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	210	154	16,388	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	120	110	11,650	2027/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	400	349	36,914	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	60	56	6,005	2029/12/01
	CANADA GOVERNMENT	国債証券	2.7500	50	46	4,893	2064/12/01
小	計		—	5,910	5,448	576,083	—
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7500	160	169	16,081	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	130	129	12,278	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	130	128	12,164	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5000	180	193	18,350	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	180	180	17,080	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2500	170	175	16,643	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	120	118	11,281	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	160	143	13,615	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	320	310	29,421	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	100	92	8,745	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	190	178	16,925	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	140	119	11,313	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	110	105	10,023	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	180	171	16,240	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	200	185	17,638	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	130	109	10,418	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	290	244	23,166	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	340	318	30,258	2024/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	170	137	13,005	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	260	212	20,115	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	190	119	11,310	2051/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	140	127	12,048	2025/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	340	270	25,672	2031/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	230	205	19,476	2026/09/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	167	15,929	2032/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	100	93	8,896	2033/11/21
小	計		—	4,860	4,407	418,101	—
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	230	231	22,781	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	380	381	37,500	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	100	96	9,458	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	220	229	22,619	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	200	200	19,766	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	100	99	9,779	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	120	114	11,245	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	500	491	48,334	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	210	193	19,080	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	230	228	22,493	2028/05/01

ヘッジ付き外国債券バッシュ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	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	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	120	118	11,700	2024/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	100	92	9,066	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	180	141	13,920	2050/03/01
小計			—	2,690	2,619	257,749	—
イギリス	UK GILT	国債証券	6.0000	100	119	19,298	2028/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	210	238	38,543	2032/06/07
	UK GILT	国債証券	5.0000	80	84	13,618	2025/03/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	180	206	33,393	2036/03/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	110	135	21,878	2038/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	170	220	35,667	2055/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	160	193	31,337	2046/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	130	139	22,578	2027/12/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	210	256	41,516	2042/12/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	240	278	45,066	2030/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	90	111	18,039	2049/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	130	151	24,505	2039/09/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	150	174	28,214	2034/09/07
	UK GILT	国債証券	4.0000	110	140	22,723	2060/01/22
	UK GILT	国債証券	4.2500	140	164	26,557	2040/12/07
	UK GILT	国債証券	3.7500	140	163	26,410	2052/07/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	180	186	30,167	2044/01/22
	UK GILT	国債証券	2.2500	120	119	19,307	2023/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	170	203	32,887	2068/07/22
	UK GILT	国債証券	2.7500	250	249	40,369	2024/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	200	215	34,815	2045/01/22
	UK GILT	国債証券	2.0000	110	107	17,427	2025/09/07
	UK GILT	国債証券	2.5000	140	132	21,368	2065/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	180	171	27,807	2026/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	150	111	18,001	2047/07/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	200	169	27,495	2037/09/07
	UK GILT	国債証券	1.7500	140	107	17,360	2057/07/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	270	252	40,827	2027/07/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	110	103	16,818	2028/10/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	180	127	20,599	2071/10/22
	UK GILT	国債証券	1.0000	220	213	34,518	2024/04/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	110	85	13,912	2049/01/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	100	73	11,949	2054/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	100	88	14,375	2029/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	130	122	19,860	2025/06/07
	UK GILT	国債証券	0.3750	160	133	21,671	2030/10/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	200	148	24,065	2041/10/22
	UK GILT	国債証券	0.5000	140	65	10,592	2061/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	80	45	7,300	2050/10/22
	UK GILT	国債証券	0.1250	130	118	19,249	2026/01/30
	UK GILT	国債証券	0.1250	90	78	12,733	2028/01/31
	UK GILT	国債証券	0.1250	290	278	45,011	2024/01/31
	UK GILT	国債証券	0.6250	180	134	21,765	2035/07/31
UK GILT	国債証券	0.2500	200	161	26,169	2031/07/31	
UK GILT	国債証券	0.3750	100	90	14,666	2026/10/22	
UK GILT	国債証券	0.8750	110	70	11,475	2046/01/31	
UK GILT	国債証券	1.2500	250	168	27,324	2051/07/31	
UK GILT	国債証券	0.8750	120	98	15,887	2033/07/31	
UK GILT	国債証券	0.2500	160	149	24,254	2025/01/31	
UK GILT	国債証券	0.5000	170	148	24,036	2029/01/31	
UK GILT	国債証券	1.5000	90	64	10,440	2053/07/31	
UK GILT	国債証券	1.0000	150	128	20,785	2032/01/31	
UK GILT	国債証券	1.1250	90	51	8,327	2073/10/22	

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	期 末					
			利率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
	UK TSY GILT	国債証券	1.1250	190	143	23,211	2039/01/31	
小		計	—	8,310	7,899	1,278,192	—	
イスラエル	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.7500	230	224	9,384	2025/08/31	
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	290	309	12,961	2047/03/31	
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.0000	140	135	5,679	2027/03/31	
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	650	643	26,943	2023/11/30	
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	120	122	5,117	2024/03/31	
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.2500	300	341	14,293	2026/10/30	
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.2500	270	262	10,992	2028/09/28	
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.0000	250	220	9,227	2030/03/31	
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	5.5000	90	120	5,026	2042/01/31	
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	260	212	8,891	2037/05/31	
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.3000	100	87	3,668	2032/04/30		
小		計	—	2,700	2,678	112,184	—	
デンマーク	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5000	1,170	1,619	29,784	2039/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5000	400	402	7,410	2023/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.7500	480	487	8,964	2025/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	830	790	14,529	2027/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	780	722	13,291	2029/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.2500	480	312	5,743	2052/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.0000	690	589	10,844	2031/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.0000	460	448	8,249	2024/11/15	
小		計	—	5,290	5,373	98,816	—	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	500	496	7,026	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	810	775	10,980	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	440	412	5,830	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	420	391	5,542	2027/02/17	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	360	335	4,748	2028/04/26	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	580	524	7,420	2029/09/06	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.3750	550	477	6,749	2030/08/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	390	327	4,640	2031/09/17	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.1250	240	216	3,062	2032/05/18	
	小		計	—	4,290	3,957	56,002	—
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	3.5000	340	424	5,490	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	750	745	9,639	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.2500	500	520	6,731	2032/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.5000	800	806	10,431	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.0000	1,030	987	12,765	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	900	843	10,909	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	560	517	6,694	2029/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	540	466	6,033	2031/05/12	
小		計	—	5,420	5,312	68,695	—	
メキシコ	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	8.0000	2,160	2,110	14,533	2023/12/07	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	10.0000	2,550	2,581	17,777	2024/12/05	
	MEX BONOS DE DESARROLLO	国債証券	7.5000	3,050	2,881	19,840	2027/06/03	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	10.0000	320	348	2,396	2036/11/20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	3,670	3,590	24,721	2029/05/31	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	2,700	2,563	17,649	2038/11/18	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	4,540	4,215	29,026	2031/05/29	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	2,000	1,751	12,061	2042/11/13	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	1,520	1,387	9,553	2034/11/23	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.7500	4,140	3,730	25,687	2026/03/05	
	小		計	—	—	—	—	—

ヘッジ付き外国債券バッシブ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	2,290	2,062	14,198	2047/11/07
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	2,980	2,901	19,975	2024/09/05
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.0000	1,300	1,175	8,094	2025/03/06
小	計		—	33,220	31,300	215,517	—
中	国			千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,000	4,047	80,766	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	1,000	1,007	20,095	2024/09/02
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5600	4,000	4,027	80,357	2023/10/21
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	9,000	9,185	183,280	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7200	3,000	3,312	66,089	2051/04/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0200	6,000	6,152	122,772	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	4,000	4,017	80,167	2024/03/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	3,000	3,009	60,052	2027/04/15
小	計		—	34,000	34,759	693,582	—
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	50	43	1,234	2026/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	170	140	4,042	2027/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	480	382	10,955	2029/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,310	1,189	34,114	2024/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	500	429	12,303	2025/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	450	308	8,833	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	860	665	19,085	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	101	2,902	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	720	634	18,198	2027/05/25
小	計		—	4,690	3,894	111,670	—
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
(アイルランド)	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	5.4000	100	110	15,149	2025/03/13
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.4000	80	83	11,367	2024/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.4000	100	105	14,418	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.0000	100	93	12,794	2045/02/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.0000	120	119	16,275	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.7000	70	65	8,998	2037/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.9000	80	77	10,555	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3000	50	46	6,354	2033/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3500	60	58	7,953	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.1000	100	96	13,214	2029/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.5000	70	56	7,756	2050/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.4000	40	32	4,420	2035/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.2000	60	56	7,756	2027/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.2000	40	35	4,826	2030/10/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.0000	100	84	11,526	2031/10/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.3500	120	102	13,976	2032/10/18
	IRISH GOVT	国債証券	0.5500	50	36	5,010	2041/04/22
(オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	5.5000	140	170	23,262	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	4.0000	180	228	31,235	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	200	261	35,721	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	180	193	26,453	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.0000	170	173	23,734	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	236	32,350	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	210	205	28,046	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	160	155	21,314	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	170	165	22,660	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	140	138	18,947	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	140	135	18,472	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	130	119	16,388	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	160	128	17,544	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	120	106	14,609	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	210	198	27,178	2027/01/15

ヘッジ付き外国債券バッシュ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	130	76	10,421	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	160	139	19,087	2031/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	80	60	8,231	2038/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	110	100	13,710	2029/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	60	57	7,889	2026/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	100	89	12,217	2032/07/15
(ベルギー)	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	160	195	26,683	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0000	220	287	39,306	2035/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.2500	180	226	31,007	2041/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5000	100	111	15,252	2026/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	80	95	12,998	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6000	170	175	23,963	2024/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	90	109	14,937	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	80	86	11,885	2034/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	170	168	23,060	2025/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	160	149	20,496	2031/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9000	90	84	11,598	2038/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	210	208	28,447	2026/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6000	100	83	11,396	2047/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.2000	80	79	10,862	2023/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.1500	130	117	16,072	2066/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	130	126	17,296	2027/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.5000	180	178	24,373	2024/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4500	60	53	7,311	2037/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	230	221	30,272	2028/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.2500	100	93	12,771	2033/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9000	170	162	22,204	2029/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.7000	100	83	11,436	2050/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.1000	120	106	14,512	2030/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.4000	90	63	8,699	2040/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	105	97	13,330	2027/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.6500	30	14	2,012	2071/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	140	118	16,183	2031/10/22
BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.3500	170	145	19,870	2032/06/22	
BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4000	170	127	17,503	2053/06/22	
(フランス)	FRANCE O. A. T.	国債証券	6.0000	180	206	28,298	2025/10/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.5000	340	424	58,011	2029/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.7500	440	595	81,489	2032/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.7500	300	388	53,071	2035/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	230	308	42,129	2055/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	340	420	57,506	2038/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.2500	340	353	48,405	2023/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.5000	330	437	59,837	2041/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	170	233	31,866	2060/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.5000	480	518	70,930	2026/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	470	500	68,495	2027/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.2500	280	322	44,046	2045/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.2500	350	358	49,002	2024/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	600	609	83,361	2024/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	660	702	96,114	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	640	629	86,040	2025/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	450	447	61,171	2025/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	480	471	64,505	2031/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	480	466	63,813	2026/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	390	347	47,545	2036/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	120	98	13,447	2066/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.2500	360	343	47,033	2026/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	300	280	38,392	2039/06/25

ヘッジ付き外国債券バッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	450	441	60,423	2027/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	310	286	39,185	2048/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	710	681	93,127	2028/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	340	310	42,411	2034/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	720	686	93,916	2028/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	410	405	55,398	2024/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	410	336	45,948	2050/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	570	531	72,660	2029/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	510	495	67,775	2025/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	400	356	48,711	2029/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	280	182	24,917	2052/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	540	517	70,769	2026/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	430	373	51,048	2030/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	310	229	31,331	2040/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	300	296	40,572	2024/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	80	37	5,063	2072/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	120	82	11,218	2044/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	650	550	75,333	2031/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	350	329	44,996	2027/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	310	258	35,343	2032/05/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	0.7500	250	158	21,722	2053/05/25
(ドイツ)	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.5000	160	200	27,432	2027/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.6250	310	382	52,246	2028/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	170	204	27,994	2028/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	130	176	24,137	2030/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.5000	220	294	40,338	2031/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	230	315	43,130	2034/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.0000	260	344	47,080	2037/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.2500	170	238	32,667	2039/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	220	330	45,227	2040/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	3.2500	180	235	32,161	2042/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	260	309	42,294	2044/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.0000	250	253	34,651	2023/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	390	395	54,053	2024/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7500	530	538	73,676	2024/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	400	483	66,051	2046/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	230	227	31,177	2025/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	210	210	28,822	2024/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	300	300	41,131	2025/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	220	216	29,634	2026/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	320	307	42,099	2026/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	320	309	42,332	2027/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	430	418	57,247	2027/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.2500	280	266	36,409	2048/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	230	222	30,430	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	220	208	28,553	2028/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	250	236	32,310	2029/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	250	230	31,572	2029/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	280	185	25,346	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	210	192	26,337	2030/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	200	166	22,761	2035/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	430	391	53,482	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	220	207	28,426	2027/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	350	315	43,193	2031/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	250	204	27,966	2036/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	130	86	11,811	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	200	186	25,504	2028/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	380	339	46,480	2031/08/15

ヘッジ付き外国債券バッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	170	109	14,916	2052/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	250	221	30,253	2032/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	120	111	15,228	2038/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7000	50	51	7,053	2032/08/15
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	0.0000	210	208	28,526	2023/09/15
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	200	198	27,158	2023/10/13
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	410	405	55,465	2024/04/05
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	310	304	41,625	2024/10/18
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	190	185	25,389	2025/04/11
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	310	301	41,261	2025/10/10
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	210	202	27,752	2026/04/10
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	170	162	22,274	2026/10/09
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	150	142	19,541	2027/04/16
(スペイン)	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	6.0000	260	323	44,273	2029/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2000	230	174	23,813	2040/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.7500	310	402	54,999	2032/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.2000	270	316	43,339	2037/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.9000	180	231	31,665	2040/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.8000	140	147	20,172	2024/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.7000	200	253	34,614	2041/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.6500	140	153	20,952	2025/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.9000	110	128	17,526	2026/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	250	296	40,510	2028/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	160	217	29,787	2044/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.8000	80	83	11,428	2024/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7500	230	237	32,480	2024/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.6000	200	201	27,528	2025/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.1500	160	163	22,378	2025/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	300	295	40,345	2030/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	390	394	54,008	2026/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.4000	300	312	42,672	2023/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.9000	150	148	20,294	2046/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	150	154	21,195	2066/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.3000	250	246	33,756	2026/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.5000	190	187	25,693	2027/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.3500	160	157	21,498	2033/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	180	176	24,176	2027/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	280	272	37,313	2028/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7000	160	151	20,726	2048/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	180	174	23,906	2028/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	230	222	30,368	2029/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.8500	200	181	24,855	2035/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.2500	180	176	24,149	2024/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.6000	220	198	27,141	2029/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	230	203	27,839	2030/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	310	295	40,414	2027/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	190	117	16,080	2050/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	380	367	50,287	2025/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2500	240	222	30,470	2030/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	210	198	27,195	2026/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	230	225	30,829	2024/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.1000	270	223	30,584	2031/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	70	39	5,355	2071/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	200	180	24,722	2028/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8500	120	90	12,435	2037/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	200	169	23,164	2031/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	100	71	9,751	2042/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	210	194	26,554	2027/01/31

ヘッジ付き外国債券バッシュ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.7000	150	127	17,445	2032/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	210	201	27,558	2025/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9000	100	75	10,373	2052/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.5500	110	109	15,041	2032/10/31
(イタリア)	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	9.0000	170	185	25,312	2023/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.5000	190	224	30,740	2027/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	140	153	20,993	2028/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	210	184	25,217	2030/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	190	132	18,108	2037/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.2500	250	284	38,972	2029/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.0000	250	299	40,995	2031/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.7500	360	427	58,404	2033/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	220	248	33,986	2034/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	250	259	35,500	2037/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	220	254	34,828	2039/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	250	267	36,604	2025/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	180	208	28,516	2040/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	310	332	45,430	2026/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	70	72	9,979	2024/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	170	194	26,582	2044/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.7500	350	362	49,582	2024/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	240	245	33,572	2030/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	130	131	17,956	2024/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	180	165	22,673	2046/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	430	421	57,656	2025/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	240	205	28,039	2032/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	220	217	29,765	2025/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6000	230	222	30,470	2026/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.7000	150	125	17,097	2047/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2500	170	143	19,690	2036/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.2500	270	255	34,965	2026/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.6500	160	158	21,727	2023/10/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	90	71	9,783	2067/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	150	134	18,352	2033/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2000	180	175	24,024	2027/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	330	330	45,174	2024/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	180	170	23,281	2048/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0500	280	270	37,011	2027/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	250	246	33,754	2024/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.9500	100	90	12,403	2038/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	320	306	41,889	2028/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	200	195	26,745	2025/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	340	336	46,033	2028/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	320	324	44,320	2023/10/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	240	240	32,925	2025/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.3500	170	164	22,476	2035/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	200	200	27,413	2049/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.0000	200	198	27,142	2029/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1000	250	245	33,638	2026/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.1000	120	109	15,018	2040/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.3500	370	323	44,199	2030/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.3500	170	162	22,283	2025/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.8500	240	222	30,396	2027/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	180	150	20,572	2030/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	190	146	19,980	2036/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	150	115	15,842	2050/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.3000	100	99	13,550	2023/08/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	210	191	26,244	2027/09/15

ヘッジ付き外国債券バッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	170	159	21,767	2026/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8000	310	229	31,383	2041/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.7000	140	91	12,455	2051/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9000	210	170	23,370	2031/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.6000	290	226	31,008	2031/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.2500	100	86	11,800	2028/03/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	130	85	11,740	2045/04/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	430	418	57,206	2024/04/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1500	50	33	4,582	2072/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	250	216	29,639	2028/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	200	160	21,892	2031/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	240	234	32,106	2024/01/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	240	217	29,683	2026/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.4500	290	245	33,528	2029/02/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	220	173	23,726	2032/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	60	57	7,821	2024/12/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1500	70	49	6,768	2052/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	190	186	25,508	2023/11/29
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.1000	50	46	6,351	2027/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	180	175	24,035	2029/06/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	70	65	8,976	2038/03/01
	BTPS	国債証券	0.0000	220	211	28,988	2024/08/15
(フィンランド)	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.7500	100	107	14,645	2028/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.6250	40	42	5,837	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	60	55	7,556	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.8750	100	99	13,575	2025/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	70	68	9,330	2026/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	60	59	8,144	2023/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.3750	50	43	5,919	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	40	38	5,227	2027/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.1250	50	45	6,218	2034/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	80	75	10,289	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	50	46	6,330	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	60	58	8,049	2024/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	40	30	4,217	2036/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.2500	50	35	4,890	2040/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	70	61	8,353	2030/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	20	11	1,568	2052/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	40	34	4,714	2031/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	40	37	5,182	2026/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	30	21	2,950	2043/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	50	48	6,590	2032/09/15
(オーストリア)	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	6.2500	80	98	13,487	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.1500	220	274	37,526	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.8500	100	112	15,423	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.8000	50	69	9,457	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	50	58	8,031	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.7500	80	80	11,056	2023/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.4000	60	62	8,504	2034/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.6500	80	80	11,074	2024/10/21
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.2000	100	100	13,691	2025/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	150	146	20,097	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	70	61	8,397	2047/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	150	144	19,736	2027/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	130	124	17,050	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	110	102	14,003	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	160	157	21,495	2024/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	120	105	14,419	2030/02/20

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	80	55	7,612	2051/03/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	100	73	10,110	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	50	33	4,583	2040/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	100	85	11,718	2031/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7000	50	27	3,755	2071/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	90	87	11,942	2025/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.2500	110	84	11,603	2036/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	30	27	3,711	2028/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.9000	100	90	12,429	2032/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.8500	50	46	6,361	2049/05/23
小	計		—	67,405	66,393	9,079,320	—
合	計		—	—	—	26,738,023	—

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 投資信託財産の構成

(2022年8月25日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 26,738,023	% 97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	700,054	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	27,438,077	100.0

※期末における外貨建資産（26,650,140千円）の投資信託財産総額（27,438,077千円）に対する比率は97.1%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.98円、1カナダ・ドル=105.74円、1オーストラリア・ドル=94.87円、1シンガポール・ドル=98.39円、1イギリス・ポンド=161.81円、1イスラエル・シェケル=41.884円、1デンマーク・クローネ=18.39円、1ノルウェー・クローネ=14.15円、1スウェーデン・クローナ=12.93円、1メキシコ・ペソ=6.885円、1オフショア・人民元=19.954円、1ポーランド・ズロチ=28.672円、1ユーロ=136.75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

(2022年8月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	54,919,450,567円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	543,273,980
公 社 債 (評 価 額)	26,738,023,192
未 収 入 金	27,487,147,390
未 収 利 息	117,619,196
前 払 費 用	33,386,809
(B) 負 債	28,426,655,200
未 払 金	28,426,654,710
そ の 他 未 払 費 用	490
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	26,492,795,367
元 本	20,045,973,704
次 期 繰 越 損 益 金	6,446,821,663
(D) 受 益 権 総 口 数	20,045,973,704口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	13,216円

※当期における期首元本額17,264,503,118円、期中追加設定元本額10,702,727,771円、期中一部解約元本額7,921,257,185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)	3,259,160,926円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,004,157,726円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	812,805,747円
イオン・バランス戦略ファンド	1,039,495,800円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,401,355,805円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	905,322,248円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,673,052,862円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	409,709,664円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	133,189,636円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	56,270,507円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	501,457,240円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,154,681,049円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	885,316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>	4,523,654,940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>	363,835,881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>	354,304,415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>	452,633,942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2021年8月26日 至2022年8月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	452,472,193円
受 取 利 息	452,560,727
そ の 他 収 益 金	133
支 払 利 息	△ 88,667
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△3,990,163,912
売 買 益	5,660,011,463
売 買 損	△9,650,175,375
(C) そ の 他 費 用 等	△ 16,038,887
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△3,553,730,606
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,066,032,704
(F) 解 約 差 損 益 金	△3,444,593,120
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,379,112,685
(H) 合 計 (D + E + F + G)	6,446,821,663
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	6,446,821,663

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

第18期（2020年12月18日から2021年12月17日まで）

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

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

■ 最近 5 期の運用実績

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

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

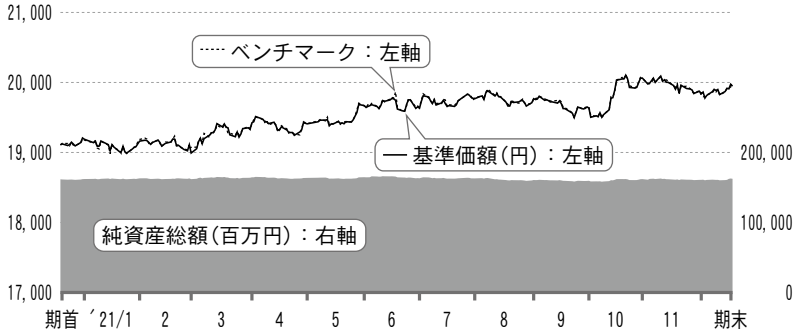
年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		公 社 債 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2020年12月17日	円 19,109	% —	193.48	% —	% 99.0
12月末	19,189	0.4	194.18	0.4	98.6
2021年1月末	19,162	0.3	194.26	0.4	98.7
2月末	18,992	△0.6	193.11	△0.2	98.8
3月末	19,424	1.6	196.58	1.6	98.8
4月末	19,409	1.6	196.54	1.6	98.7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

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

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

基準価額等の推移



期首	19,109円
期末	19,947円
騰落率	+4.4%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

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

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

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

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

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

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

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

債券市場

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

為替市場

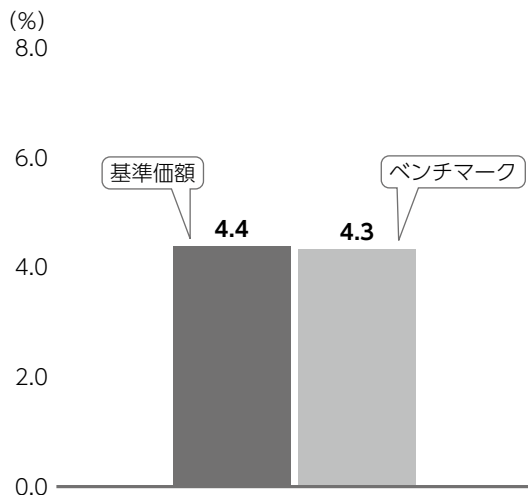
米欧を中心とした経済再開の本格化やインフレ率上昇懸念の高まりから、グローバルに中央銀行の金融緩和策の縮小が意識される中、米欧の金利先高観が強まり、米ドルを中心に対円で投資通貨が上昇しました。

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

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

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

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

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

上方乖離要因

・キャッシュフローに伴う売買のタイミング

2 今後の運用方針

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

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

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

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

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

期中の平均基準価額は19,551円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

公社債

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

			買 付 額	売 付 額
外 国	フ ラ ン ス	国 債 証 券	26,142	32,170
	ド イ ツ	国 債 証 券	22,150	24,196
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	7,855	8,933
	イ タ リ ア	国 債 証 券	15,196	23,507
	フィンランド	国 債 証 券	1,451	3,116
	オーストリア	国 債 証 券	2,517	4,650

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

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

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

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

■ 組入れ資産の明細（2021年12月17日現在）

公社債

A 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 644,020	千アメリカ・ドル 672,251	千円 76,549,238	% 47.1	% —	% 21.6	% 17.3	% 8.3
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 32,300	千カナダ・ドル 35,262	3,142,202	1.9	—	1.0	0.7	0.2
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 29,350	千オーストラリア・ドル 32,046	2,618,502	1.6	—	1.2	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,950	千シンガポール・ドル 8,624	720,460	0.4	—	0.3	0.0	0.1

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,000	3,042	346,399	2023/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,000	3,056	348,080	2023/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	5,000	5,193	591,366	2026/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	3,100	3,190	363,269	2023/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,600	4,299	489,577	2046/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,000	3,096	352,616	2023/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,631	527,407	2027/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,200	2,272	258,780	2024/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,500	3,055	347,901	2047/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	6,500	6,703	763,366	2024/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,000	2,059	234,465	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,000	2,062	234,811	2024/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	4,900	5,196	591,742	2027/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,200	2,696	307,014	2047/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,300	3,397	386,923	2024/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	4,100	4,224	480,999	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	3,500	3,620	412,227	2024/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,200	4,429	504,333	2027/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,800	4,467	508,663	2047/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	3,800	3,905	444,704	2024/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	4,000	4,140	471,453	2024/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	800	831	94,654	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,500	1,764	200,921	2047/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,643	528,779	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,600	2,693	306,655	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,100	3,224	367,116	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,200	1,227	139,722	2023/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,400	3,563	405,741	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,800	5,215	593,931	2028/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,100	3,821	435,206	2048/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	4,000	4,104	467,418	2023/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	2,113	240,620	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,300	2,422	275,873	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,900	2,989	340,374	2023/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,200	2,336	266,090	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	9,000	9,866	1,123,541	2028/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,400	3,030	345,026	2048/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,000	1,032	117,623	2023/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,100	1,169	133,143	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,600	4,874	555,020	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	2,070	235,806	2023/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	4,500	4,947	563,333	2028/08/15

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	5,400	6,674	760,020	2048/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,100	2,228	253,716	2025/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,800	3,939	448,642	2023/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	4,000	4,286	488,110	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,000	1,042	118,663	2023/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,100	3,324	378,613	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,900	3,244	369,486	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	3,100	4,098	466,672	2048/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,000	2,087	237,658	2023/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,900	1,975	224,963	2023/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,500	2,673	304,422	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	4,400	4,667	531,440	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,700	2,864	326,135	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,700	2,938	334,661	2029/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,800	4,720	537,567	2049/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	3,700	3,834	436,688	2024/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	8,500	8,980	1,022,639	2026/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	13,300	13,919	1,584,984	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,800	3,933	447,898	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	4,100	4,399	500,966	2029/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,400	1,703	193,990	2049/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	6,200	6,348	722,867	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	850	870	99,159	2024/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	4,450	4,545	517,646	2029/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,500	3,786	431,189	2049/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	7,100	7,171	816,561	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,900	3,981	453,352	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	5,500	5,596	637,244	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	4,000	4,125	469,782	2029/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,900	2,111	240,404	2049/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	200	204	23,256	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	800	813	92,675	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	4,500	4,551	518,256	2030/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,800	2,876	327,552	2050/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,000	1,992	226,938	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,500	1,477	168,222	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	1,500	1,455	165,773	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	2,400	2,466	280,822	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	1,000	1,015	115,648	2027/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	5,000	4,988	568,012	2023/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,500	1,507	171,670	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,000	1,013	115,377	2025/01/31

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,000	3,035	345,651	2023/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	4,000	4,052	461,437	2022/12/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,500	7,058	803,782	2030/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	5,100	4,380	498,795	2050/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,500	3,092	352,086	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	3,000	2,884	328,451	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	7,700	7,673	873,747	2023/06/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,938	334,576	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	3,000	2,888	328,932	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,400	2,334	265,857	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	4,300	4,273	486,654	2023/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	4,400	4,227	481,412	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	3,300	3,205	365,054	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	4,700	4,481	510,350	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	8,800	8,264	941,070	2030/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	4,500	3,986	453,963	2050/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	8,000	7,943	904,510	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,000	1,939	220,853	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	7,800	7,417	844,602	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	5,700	5,651	643,503	2023/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	7,000	6,704	763,460	2030/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,200	3,013	343,118	2050/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	8,500	8,310	946,339	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	5,800	5,799	660,393	2051/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	6,700	6,486	738,606	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,000	1,943	221,297	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,912	331,679	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	2,100	2,020	230,047	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,200	6,924	788,471	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	3,000	2,978	339,205	2023/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	7,700	7,608	866,382	2024/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	1,800	1,797	204,644	2022/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,300	3,367	383,459	2031/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,500	4,436	505,128	2031/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	4,700	4,843	551,576	2051/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	3,600	3,511	399,810	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	5,900	5,777	657,865	2028/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,500	4,473	509,412	2028/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	4,400	4,371	497,836	2024/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,100	3,087	351,521	2031/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	5,200	5,179	589,808	2024/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,200	4,215	480,061	2026/11/30

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	6,000	6,013	684,709	2028/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	6.2500	800	876	99,752	2023/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.0000	1,000	1,199	136,616	2026/02/15
	US TREASURY BOND	国債証券	6.1250	1,000	1,278	145,611	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	5.2500	500	630	71,782	2028/11/15
	US TREASURY BOND	国債証券	5.3750	320	431	49,154	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	200	254	28,937	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	300	416	47,400	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	300	428	48,775	2039/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	700	986	112,314	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	600	870	99,178	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	900	1,273	145,037	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	500	666	75,883	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	600	836	95,260	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.7500	900	1,334	151,986	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	300	426	48,545	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	1,500	1,974	224,875	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,000	1,213	138,156	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	800	954	108,695	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	2,297	261,632	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	300	344	39,255	2042/11/15
	小 計		—	644,020	672,251	76,549,238	—
カ ナ ダ	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	千カナダ・ドル 250	千カナダ・ドル 330	29,439	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	500	723	64,494	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.0000	1,450	2,125	189,361	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0000	1,500	2,085	185,799	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	1,300	1,769	157,641	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,000	2,020	180,018	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	2,100	2,175	193,856	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,000	1,040	92,680	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,400	1,724	153,699	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,900	2,944	262,354	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	600	594	52,939	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,100	1,113	99,213	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,200	1,223	108,985	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	700	733	65,392	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,900	2,039	181,729	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,000	1,027	91,601	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,000	2,025	180,497	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	5,900	5,890	524,934	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	2,700	2,640	235,318	2025/09/01

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,500	2,583	391,933	2046/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	1,092	165,754	2027/12/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	1,350	2,256	342,300	2042/12/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	1,150	1,555	236,044	2030/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	1,631	247,546	2049/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,250	1,923	291,837	2039/09/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	1,100	1,584	240,337	2034/09/07
	UK GILT	国債証券	4.0000	1,700	3,479	527,862	2060/01/22
	UK GILT	国債証券	4.2500	700	1,098	166,655	2040/12/07
	UK GILT	国債証券	3.7500	1,200	2,102	318,974	2052/07/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	1,600	2,315	351,327	2044/01/22
	UK GILT	国債証券	2.2500	2,700	2,785	422,543	2023/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	1,450	3,024	458,881	2068/07/22
	UK GILT	国債証券	2.7500	600	636	96,588	2024/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	1,650	2,505	380,078	2045/01/22
	UK GILT	国債証券	2.0000	1,100	1,159	175,957	2025/09/07
	UK GILT	国債証券	2.5000	1,600	2,644	401,252	2065/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	1,300	1,357	205,930	2026/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	1,700	1,901	288,431	2047/07/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	900	1,002	152,139	2037/09/07
	UK GILT	国債証券	1.2500	1,200	1,246	189,055	2027/07/22
	UK GILT	国債証券	0.7500	2,650	2,666	404,607	2023/07/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	900	962	146,054	2028/10/22
	UK GILT	国債証券	1.0000	800	810	122,993	2024/04/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	850	1,011	153,498	2049/01/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	500	602	91,426	2054/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	1,000	1,018	154,472	2029/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	800	804	122,031	2025/06/07
	UK GILT	国債証券	0.3750	1,800	1,749	265,471	2030/10/22
	UK GILT	国債証券	0.1250	500	499	75,711	2023/01/31
	UK GILT	国債証券	0.1250	1,500	1,475	223,897	2026/01/30
	UK GILT	国債証券	0.6250	600	575	87,304	2035/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	1,600	1,523	231,175	2031/07/31
	UK TSY GILT	国債証券	1.1250	800	817	124,058	2039/01/31
	小 計		—	48,450	64,546	9,793,053	—
イスラエル	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	4,100	5,358	196,456	2047/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	2,900	2,980	109,271	2023/11/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.2500	3,300	4,218	154,657	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.2500	1,500	1,651	60,548	2028/09/28
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.1500	6,600	6,609	242,309	2023/07/31
小 計		—	18,400	20,818	763,243	—	

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0200	6,000	6,063	108,237	2031/05/27
	小 計		—	39,000	39,234	700,385	—
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	千マレーシア・リンギット 7,700	千マレーシア・リンギット 7,780	210,259	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	5,000	5,301	143,269	2030/04/15
	MALAYSIA GOVERNMENT	国債証券	3.9550	5,300	5,481	148,119	2025/09/15
	MALAYSIA GOVERNMENT	国債証券	4.7360	6,400	6,767	182,876	2046/03/15
	MALAYSIA GOVT	国債証券	3.4780	2,500	2,535	68,507	2024/06/14
	小 計		—	26,900	27,865	753,031	—
ポーランド	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 6,100	千ポーランド・ズロチ 7,141	198,867	2029/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	6,000	5,843	162,726	2028/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,000	3,989	111,096	2023/01/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,463	124,281	2024/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,800	2,599	72,395	2025/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,544	43,010	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,311	64,375	2023/04/25
	小 計		—	27,600	27,894	776,753	—
ユ ー ロ				千ユーロ	千ユーロ		
アイルランド	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	5.4000	800	954	123,183	2025/03/13
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.9000	500	528	68,167	2023/03/20
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.4000	500	545	70,415	2024/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.4000	600	727	93,860	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.0000	1,000	1,324	170,837	2045/02/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.0000	1,000	1,064	137,300	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.7000	300	360	46,461	2037/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.9000	700	752	97,038	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3000	1,000	1,126	145,385	2033/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3500	500	564	72,852	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.1000	1,600	1,748	225,540	2029/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.5000	500	603	77,818	2050/05/15
オランダ	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	5.5000	700	958	123,661	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	4.0000	1,800	2,916	376,262	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	500	524	67,674	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	1,300	2,288	295,292	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	600	779	100,557	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,600	1,663	214,625	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,000	1,069	137,918	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,600	2,698	348,141	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	1,700	1,750	225,850	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,700	1,784	230,184	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	400	428	55,245	2027/07/15

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	3.2500	700	1,205	155,578	2042/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	2,200	3,550	458,051	2044/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	2,100	2,154	277,937	2023/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.0000	2,000	2,091	269,821	2023/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	1,300	1,341	173,019	2023/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	3,600	3,794	489,575	2024/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7500	2,200	2,319	299,207	2024/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	2,500	4,144	534,649	2046/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,500	2,595	334,900	2025/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,300	1,359	175,442	2024/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	2,050	2,175	280,653	2025/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	3,100	3,246	418,859	2026/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	2,300	2,399	309,520	2027/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	3,400	3,606	465,276	2027/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.2500	1,650	2,229	287,661	2048/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,100	2,236	288,582	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	900	947	122,196	2028/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	800	843	108,852	2029/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,500	3,627	468,043	2029/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	2,700	2,725	351,594	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,300	1,348	173,967	2030/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,800	3,896	502,699	2035/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	5,800	6,015	776,070	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	2,000	2,073	267,522	2031/08/15
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,900	1,918	247,477	2023/04/14
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,600	1,621	209,245	2023/10/13
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,300	1,322	170,562	2024/04/05
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	600	612	78,995	2024/10/18
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	3,500	3,579	461,762	2025/04/11
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,800	1,845	238,067	2025/10/10
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	800	822	106,123	2026/10/09
スペイン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	6.0000	2,200	3,145	405,814	2029/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2000	500	524	67,616	2040/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.7500	1,500	2,341	302,086	2032/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.2000	1,650	2,489	321,166	2037/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.9000	1,500	2,567	331,249	2040/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.8000	3,000	3,342	431,182	2024/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.7000	1,500	2,543	328,131	2041/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.6500	1,800	2,129	274,725	2025/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.9000	500	643	83,008	2026/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.4000	2,250	2,401	309,860	2023/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	1,500	2,031	262,038	2028/10/31

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
フィンランド	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	4.0000	600	699	90,303	2025/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	483	62,356	2028/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.6250	1,000	1,499	193,450	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	1,000	1,029	132,841	2023/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,000	1,064	137,280	2024/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	500	542	69,955	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.3750	300	386	49,852	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	400	422	54,531	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	800	848	109,416	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.2500	300	303	39,114	2040/09/15
オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	6.2500	1,000	1,381	178,195	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.1500	500	806	104,054	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.8500	500	616	79,560	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.8000	700	1,526	196,928	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	600	983	126,904	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.7500	1,000	1,045	134,881	2023/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.4000	300	388	50,150	2034/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.6500	800	853	110,086	2024/10/21
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.2000	1,000	1,068	137,830	2025/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	900	953	123,061	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	900	1,152	148,632	2047/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	1,100	1,111	143,447	2023/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	800	840	108,394	2027/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	700	748	96,547	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	550	580	74,863	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	900	912	117,734	2030/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	1,100	1,197	154,455	2051/03/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	200	280	36,199	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.8500	150	148	19,188	2120/06/30
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	800	806	104,036	2031/02/20
小 計			—	410,340	483,645	62,395,101	—
合 計			—	—	—	160,912,922	—

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2021年12月17日現在)

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

※期末における外貨建資産（162,014,412千円）の投資信託財産総額（164,409,226千円）に対する比率は98.5%です。

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

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年12月17日現在)

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

※当期における期首元本額84,615,543,547円、期中追加設定元本額10,172,463,204円、期中一部解約元本額13,375,904,420円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の第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2020年12月18日 至2021年12月17日)

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

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	24,487,844,372円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,563,065,943円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	760,198,503円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	10,603,737,345円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,105,125,950円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,392,217円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,119,007,643円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	93,650,011円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	155,624,983円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	718,495,736円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,821,569円	SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	117,631,749円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	29,780,404円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,068,564,548円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	100,943,914円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,438,731,860円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	215,809,603円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,547,910,459円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	146,490,369円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,874,996,538円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	247,645,688円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	627,347円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	25,113,488円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,237,337,020円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	75,454,990円	三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	331,971,594円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	112,630,498円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	150,359,802円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	63,013,857円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	81,175,759円
イオン・バランス戦略ファンド	117,794,452円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	33,971,193円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,988,179円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	66,333,551円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	96,352,849円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	49,304,278円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	426,754,581円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	119,676,115円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	104,874,447円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	34,468,587円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,181,590円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	16,515,743円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,252,180円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	117,826,123円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,046,403,883円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	227,846,301円	SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	648,746,322円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	12,061,797円	SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	960,695,213円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	35,271,630円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,134,108,974円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	23,882,832円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	404,802,053円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,248,709円	SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド<適格機関投資家限定>	51,663,081円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	163,477,935円	SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	141,011,485円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	3,442,227円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	295,647,332円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,390,473,483円	SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	321,381,894円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	44,105,389円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	1,395,550,617円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	7,335,907,258円		

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第19期（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年2月17日）
運用方針	主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) TOPIX (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 株比	株式先物率 (買建-売建)	純資産額
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
15期（2017年11月30日）	27,242	24.6%	2,604.86	24.5%	98.5%	1.5%	193,025
16期（2018年11月30日）	25,937	△4.8	2,475.92	△4.9	97.1%	2.8%	173,547
17期（2019年12月2日）	27,359	5.5	2,611.46	5.5	97.7%	2.3%	174,398
18期（2020年11月30日）	28,704	4.9	2,738.72	4.9	97.7%	2.0%	180,486
19期（2021年11月30日）	32,212	12.2	3,073.26	12.2	97.7%	2.4%	197,054

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年11月30日	円 28,704	% —	2,738.72	% —	% 97.7	% 2.0
12月末	29,560	3.0	2,819.93	3.0	98.8	1.7
2021年1月末	29,632	3.2	2,826.50	3.2	99.2	0.8
2月末	30,556	6.5	2,914.58	6.4	98.9	1.2
3月末	32,298	12.5	3,080.87	12.5	98.4	1.6
4月末	31,386	9.3	2,993.46	9.3	97.7	2.3
5月末	31,816	10.8	3,034.76	10.8	97.5	2.6
6月末	32,195	12.2	3,070.81	12.1	98.0	2.0
7月末	31,497	9.7	3,003.91	9.7	98.0	2.0
8月末	32,494	13.2	3,099.08	13.2	98.3	1.6
9月末	33,910	18.1	3,234.08	18.1	98.1	1.9
10月末	33,427	16.5	3,188.28	16.4	97.8	2.7
(期 末) 2021年11月30日	32,212	12.2	3,073.26	12.2	97.7	2.4

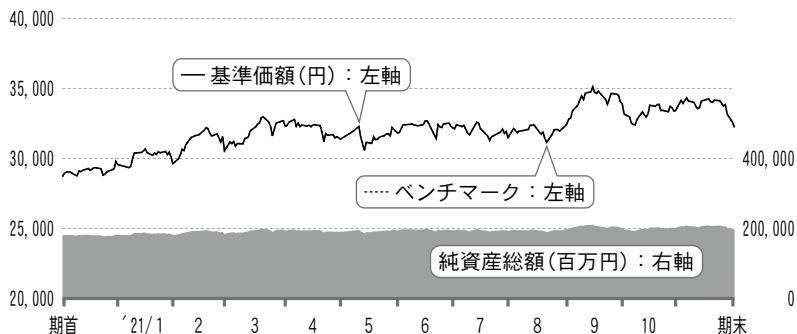
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	28,704円
期末	32,212円
騰落率	+12.2%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

上昇要因

- ・米国の追加経済対策への期待と国内製造業の好業績により、国内株式市場が上昇したこと
- ・9月の菅総理の辞任表明により、新政権の政策期待から国内株式市場が上昇したこと

下落要因

- ・期末にかけて、欧州を中心とした新型コロナウイルスの感染再拡大に加え、南アフリカでの新たな変異ウイルス（オミクロン型）の検出が嫌気され下落したこと

▶ 投資環境について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

国内株式市場は上昇しました。

期初は米国の追加経済対策への期待と国内製造業の好業績から、上昇しました。2月から8月にかけては、変異ウイルス（デルタ型）の感染が拡大する一方、国内製造業の好業績発表により、もみ合う展開となりました。

9月になると、菅総理の辞任表明により、新政権の政策期待から国内株式市場は高値を更新しました。その後、中国の不動産大手の信用不安で日本を含む世界的な株安が進行しました。しかし、債務が履行されたことや企業業績が好調な米国株が上昇したことで、国内株式市場も上昇に転じました。

期末には欧州を中心とした新型コロナウイルスの感染再拡大に加え、南アフリカでの新たな変異ウイルス（オミクロン型）の検出が嫌気され下落しました。

▶ ポートフォリオについて（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

株式組入比率

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

ポートフォリオの特性

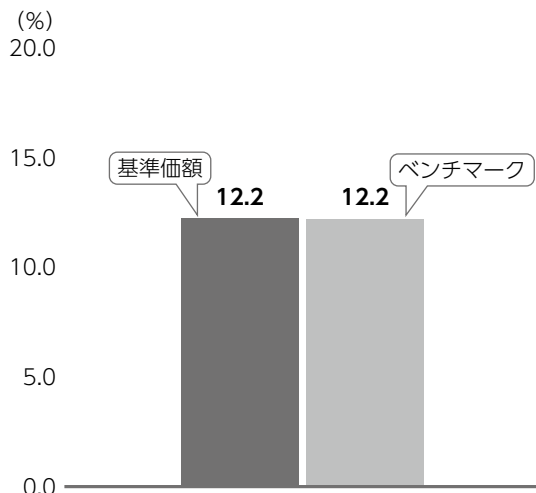
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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

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

▶ ベンチマークとの差異について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドはTOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+12.2%となり、ベンチマークの騰落率+12.2%を追随しました。

2 今後の運用方針

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 1万口当たりの費用明細（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	1円 (0) (1)	0.003% (0.000) (0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	1	0.003	

期中の平均基準価額は31,986円です。

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株	千円	千株	千円
		8,334.3 (3,590.575)	19,219,723 ()	8,658.775	20,409,478

※金額は受渡し代金。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 49,971	百万円 48,975	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	39,629,201千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	189,332,738千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.20

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

(1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	B A	%	うち利害関係人 との取引状況D	D C	%
株 式	百万円 6,507	33.9	%	百万円 8,618	42.2	%
株 式 先 物 取 引	49,971	47,251	94.6	48,975	46,260	94.5

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	百万円 114	百万円 97	百万円 1,842

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	5,504千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	4,651千円
(c) (b)／(a)	84.5%

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

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

（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 組入れ資産の明細（2021年11月30日現在）

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
	千株	千株	千円	
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	3.8	3.7	10,730	
日本水産	97.5	97.1	55,638	
マルハニチロ	14.1	15	34,155	
雪国まいたけ	5.7	8.1	9,857	
カネコ種苗	4.6	5	6,740	
サカタのタネ	11.6	11.6	36,250	
ホクト	7.1	8	14,736	
鉱業 (0.2%)				
日鉄鉱業	2.4	2.3	14,168	
三井松島ホールディングス	5.6	4.8	6,206	
I N P E X	361.1	396.9	371,895	
石油資源開発	12.4	11.7	26,804	
K & O エナジーグループ	5.6	5.5	8,261	
建設業 (2.2%)				
ヒノキヤグループ	3.4	2.9	6,142	
ショーボンドホールディングス	15.1	14.1	68,878	
ミライト・ホールディングス	27.3	31.3	61,504	
タマホーム	6.5	6.1	13,969	
ベストテラ	—	3.9	4,976	
Robot Home	—	20.8	4,596	
スペースバリューホールディングス	15.4	—	—	
ダイセキ環境ソリューション	—	2.7	4,476	
安藤・間	59.5	54.1	45,498	
東急建設	30.2	30.2	19,479	
コムシスホールディングス	34.7	31.6	78,241	
ビーアールホールディングス	13.4	17	6,001	
高松コンストラクショングループ	6.2	6.7	12,522	
東建コーポレーション	3	2.9	25,955	
オリエンタル白石	—	36.7	8,330	
大成建設	75.4	66	218,460	
大林組	224.9	227.9	190,524	
清水建設	228.5	213.8	153,294	
飛鳥建設	8.7	8.7	8,499	
長谷工コーポレーション	86.7	67.2	90,988	
松井建設	11.8	11.6	8,154	
銭高組	1.6	1.7	6,400	
鹿島建設	177	167	208,917	
不動テトラ	7.4	5.8	9,349	
大末建設	6.3	5.1	5,701	
鉄建建設	6.1	6.5	11,160	
西松建設	18	14	47,390	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
三井住友建設	55.8	53.2	22,024	
大豊建設	5.6	3.5	12,670	
前田建設工業	58.8	—	—	
奥村組	10.4	13.3	41,762	
東鉄工業	9.2	9.9	22,502	
浅沼組	3	2.9	15,254	
戸田建設	94.9	95.7	63,927	
熊谷組	10.5	11.2	29,433	
北野建設	2.2	2.7	5,535	
矢作建設工業	12.1	12.5	8,637	
ピーエス三菱	10.6	9.3	5,514	
日本ハウスホールディングス	26.1	20.7	7,182	
大東建託	24.9	23.4	287,586	
新日本建設	10.5	10.6	7,897	
N I P P O	18.1	18.6	74,586	
東亜道路工業	2	1.4	6,510	
前田道路	21	—	—	
日本道路	2.3	2.2	17,160	
東亜建設工業	8.3	5.9	14,036	
日本国土開発	22.9	22.2	11,810	
若葉建設	6	4.8	9,120	
東洋建設	29.9	25.7	13,466	
五洋建設	91.5	91.2	59,371	
世紀東急工業	13.6	12.8	10,547	
福田組	2.8	2.8	11,508	
住友林業	58	58.5	133,789	
日本基礎技術	11.7	—	—	
巴コーポレーション	15.7	14.6	6,307	
大和ハウス工業	225	211.2	700,339	
ライト工業	12.6	14.8	29,970	
積水ハウス	246.6	247.9	547,859	
北陸電気工事	—	5.2	5,465	
ユアテック	14.8	14.1	8,474	
日本リーテック	5.5	5.8	8,079	
中電工	7.2	9.9	20,067	
関電工	27.9	37.5	30,375	
きんでん	52.8	50	82,150	
東京エネシス	9.8	8.8	9,081	
トーエネック	2.9	2.9	9,048	
住友電設	6.2	5.8	11,170	
日本電設工業	11.2	11.7	18,123	
エクシオグループ	33.8	33.9	81,563	
新日本空調	6.7	6.3	13,185	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
九電工	16.1	17.7	59,472	
三機工業	16	13.6	18,672	
日揮ホールディングス	70.5	70.9	67,851	
中外炉工業	4.1	3.6	5,587	
ヤマト	9.4	8.8	6,494	
太平電業	6.1	5.3	14,341	
高砂熱学工業	16	21.1	40,258	
朝日工業社	2.2	2.2	6,179	
明星工業	15.6	17	11,084	
大気社	10.7	11.1	32,190	
ダイダン	5.4	5.4	11,070	
日比谷総合設備	7.8	7.5	13,980	
フィル・カンパニー	—	1.7	3,726	
テスホールディングス	—	4.7	11,383	
インフリア・ホールディングス	—	97.4	91,458	
O S J Bホールディングス	43.1	—	—	
東洋エンジニアリング	—	11.1	7,881	
レイズネクスト	13	10.8	12,106	
食料品（3.3%）				
ニッポン	19.3	20.1	31,496	
日清製粉グループ本社	81.9	82.2	134,479	
昭和産業	6.4	6.4	16,748	
鳥越製粉	8.2	8.7	6,177	
中部飼料	8.9	8.6	8,118	
フィード・ワン	11.1	10.3	7,354	
日本甜菜製糖	4.7	5.3	8,453	
D M三井製糖ホールディングス	5.7	6.4	11,916	
日新製糖	3.6	4.3	7,004	
森永製菓	17.2	17.3	61,069	
中村屋	1.9	2.5	9,012	
江崎グリコ	20	20	70,100	
名糖産業	3.7	5	8,250	
井村屋グループ	4.8	4.5	9,729	
不二家	4.8	4.4	9,820	
山崎製パン	54.7	54.7	80,682	
モロゾフ	1.3	1.7	8,993	
亀田製菓	4.2	4.1	17,732	
寿スピリッツ	6.9	7	43,120	
カルビー	33	33.4	85,103	
森永乳業	13.6	13.6	73,984	
六甲バター	5.9	6.5	9,932	
ヤクルト本社	50.1	54.1	306,747	
明治ホールディングス	47.9	48.1	320,346	
雪印メグミルク	17.2	17.4	33,408	
プリマハム	10.9	8.4	19,916	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本ハム	27.7	27.7	107,199	
丸大食品	7.7	7.8	11,177	
S Foods	5.8	6.3	20,695	
柿安本店	3.2	2.9	7,511	
伊藤ハム米久ホールディングス	42.4	41.4	26,578	
サッポロホールディングス	25.2	25	54,500	
アサヒグループホールディングス	158.5	171.8	720,529	
キリンホールディングス	307.9	268.3	487,501	
宝ホールディングス	54.8	50.2	61,244	
オエノンホールディングス	24.1	24.5	8,722	
養命酒製造	3.5	3.7	6,549	
コカ・コーラ ボトラーズ ジャパンホールディングス	56.3	50.9	64,388	
サントリー食品インターナショナル	48.6	48.8	195,444	
タイドグループホールディングス	3.8	3.7	18,167	
伊藤園	22	22.2	148,074	
キーコーヒー	6.4	6.9	13,392	
日清オイリオグループ	8.9	8.4	23,335	
不二製油グループ本社	17.8	15.8	35,328	
かどや製油	1.3	1.4	5,656	
J-オイルミルズ	3.8	7.4	12,217	
キッコーマン	52.2	52.6	455,516	
味の素	160.9	161.3	549,549	
ブルドックソース	—	3.9	7,991	
キュービー	40.4	38.3	88,434	
ハウス食品グループ本社	26.9	27.2	75,860	
カゴメ	29.5	27.6	76,314	
焼津水産化学工業	4.1	7.7	7,168	
アリアケジャパン	6.8	6.7	42,880	
ニチレイ	34.8	34.9	90,774	
東洋水産	37.5	35	161,000	
イートアンドホールディングス	2.6	3.6	7,484	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5.1	—	—	
日清食品ホールディングス	31	28.6	238,524	
永谷園ホールディングス	4.2	4.1	7,925	
一正蒲鉾	2.9	6.6	5,629	
フジッコ	7.7	7.5	13,560	
ロック・フィールド	8.2	7.9	11,360	
日本たばこ産業	389	391.8	890,757	
ケンコーマヨネーズ	4.8	5.2	6,609	
わらべや日洋ホールディングス	6	5.3	9,762	
なとり	4.6	5.2	9,885	
ピックルスコーポレーション	2.1	4.1	7,236	
ファーマフーズ	—	7	15,904	
ユーグレナ	31	38.5	30,607	

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
紀文食品	—	5	4,895	
ミヨシ油脂	4.5	5.1	6,461	
理研ビタミン	7.1	8.1	12,984	
繊維製品（0.5%）				
片倉工業	11.4	—	—	
グンゼ	5.1	5.1	20,119	
東洋紡	29.2	29.2	34,894	
ユニチカ	25.2	23.1	6,675	
富士紡ホールディングス	4	3.5	13,177	
倉敷紡績	7.6	6.7	12,207	
シキボウ	—	8.2	7,330	
日本毛織	22.9	23.3	19,595	
帝国繊維	8.3	9.1	17,954	
帝人	57.7	68	88,468	
東レ	514.8	519.2	343,087	
住江織物	2.6	3.3	5,062	
アツギ	11.3	10.2	6,793	
ダイニック	6	7.4	5,069	
セーレン	17.8	15.5	35,231	
小松マテール	13.5	13	15,301	
ワコールホールディングス	18.3	18.4	37,039	
ホギメディカル	8.3	10.2	30,600	
T S Iホールディングス	26.4	27.3	9,418	
マツオカコーポレーション	3	3.5	4,259	
ワールド	10.7	11	13,079	
オンワードホールディングス	45.9	47.4	13,651	
ゴールドウイン	13.1	13	83,850	
デサント	14.4	14.2	65,462	
パルプ・紙（0.2%）				
特種東海製紙	4.4	4.7	18,917	
王子ホールディングス	293.3	297.1	155,977	
日本製紙	31.4	35.2	37,523	
三菱製紙	12.5	—	—	
北越コーポレーション	42.2	47.8	37,284	
中越パルプ工業	4.8	—	—	
大王製紙	32	35.2	63,324	
レンゴー	68.9	68.6	52,616	
トーモク	5.3	5.6	9,861	
ザ・バック	5.8	5.9	15,812	
化学（6.8%）				
北の達人コーポレーション	26.4	26.6	9,469	
クラレ	110.5	103.4	97,609	
旭化成	469.2	473	506,819	
昭和電工	53.6	61.9	154,873	
住友化学	515.3	520.7	272,846	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
住友精化	3.2	3.6	10,872	
日産化学	39.1	38.8	253,752	
ラサ工業	3.3	2.8	4,642	
クレハ	5.9	5.6	44,240	
多木化学	2.8	2.9	15,805	
テイカ	5.8	6.2	7,210	
石原産業	14.3	12.2	14,225	
日本曹達	10.5	9	28,935	
東ソー	109	102.6	167,340	
トクヤマ	20.5	23	41,032	
セントラル硝子	14.5	12	23,328	
東亜合成	43.3	40.9	48,098	
大阪ソーダ	6.7	6.4	16,352	
関東電化工業	16.6	16.2	16,329	
デンカ	25.9	25.9	86,635	
信越化学工業	121.6	122.6	2,329,400	
日本カーバイド工業	4.7	—	—	
堺化学工業	5	5.2	10,899	
第一稀元素化学工業	9.8	8.4	10,735	
エア・ウォーター	66.1	67.3	112,862	
日本酸素ホールディングス	68.3	68.5	164,605	
日本化学工業	2.9	2.6	6,552	
日本パーカライジング	36.1	36.4	38,584	
高压ガス工業	13	13.1	9,641	
チタン工業	2.1	—	—	
四国化成工業	10.3	9.4	12,840	
ステラ ケミファ	3.7	4	10,000	
保土谷化学工業	2.6	2.4	11,100	
日本触媒	11	12.1	61,347	
大日精化学工業	5.9	5.7	12,540	
カネカ	18.1	18.4	68,080	
三菱瓦斯化学	65.8	66.2	125,051	
三井化学	65.4	64.5	196,402	
J S R	66.3	66.5	281,960	
東京応化工業	12.3	12.3	87,576	
大阪有機化学工業	6.4	6	21,900	
三菱ケミカルホールディングス	472.6	476.7	425,311	
K Hネオケム	11.6	11.8	36,344	
ダイセル	88.2	103.3	80,883	
住友ベークライト	11.5	11.3	60,003	
積水化学工業	148	148.6	274,167	
日本ゼオン	64.4	64.7	77,834	
アイカ工業	21.1	20	66,300	
宇部興産	35.1	33.2	63,080	
積水樹脂	12.6	10.8	21,805	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	数	株数	評価額
タキロンシーアイ	16	16.5	8,613	
旭有機材	5.1	4.9	7,301	
ニチバン	4.8	5.7	9,957	
リケンテクノス	20.9	19.3	9,283	
大倉工業	3.8	4.2	8,618	
積水化成工業	10.9	—	—	
群栄化学工業	2.4	2.5	8,187	
ミライアル	3.8	2.9	4,718	
ダイキョーニシカワ	15.9	16.3	8,753	
森六ホールディングス	4.9	5	8,550	
恵和	—	1.9	11,647	
日本化薬	44.9	56.8	63,275	
カーリットホールディングス	11.5	8.8	5,746	
日本精化	6.7	6	12,000	
扶桑化学工業	7	6.4	30,208	
トリケミカル研究所	1.6	7.3	25,550	
A D E K A	32.4	32.8	79,080	
日油	26.4	24.3	136,080	
新日本理化	—	20.1	4,904	
ハリマ化成グループ	7	7.3	5,774	
花王	173.2	161.3	933,443	
第一工業製薬	2.6	3.1	9,594	
石原ケミカル	—	4.5	5,692	
ニイタカ	2	2.4	5,400	
三洋化成工業	4	4.1	20,869	
大日本塗料	9.1	11	8,701	
日本ペイントホールディングス	58.4	268.5	320,320	
関西ペイント	79.6	74.1	188,955	
中国塗料	20.8	17.7	15,257	
日本特殊塗料	6.5	7	5,551	
藤倉化成	12.6	11.7	5,733	
太陽ホールディングス	5.2	10.4	33,540	
D I C	29.7	30.1	85,634	
サカタインクス	15.2	14.4	13,996	
東洋インキSCホールディングス	14	13.8	25,875	
T & K T O K A	7.6	8.4	6,266	
富士フイルムホールディングス	138.6	128.1	1,144,061	
資生堂	143.7	135.8	883,107	
ライオン	94.3	88	141,768	
高砂香料工業	5	5	13,750	
マンダム	16.6	15.7	22,356	
ミルボン	9.9	9.1	52,416	
ファンケル	29.4	29.5	101,037	
コーセー	13.6	13.7	187,279	
コタ	5.9	6	9,030	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	数	株数	評価額
ポーラ・オルビスホールディングス	31.2	31.4	63,490	
ノエビアホールディングス	6	6.1	32,025	
新日本製薬	—	3.6	4,474	
エステー	5.6	5.6	8,607	
アグロ カネシヨウ	—	3.9	—	
コニシ	11.4	11.9	19,016	
長谷川香料	12.4	12.4	34,868	
小林製薬	20.2	20.4	181,968	
荒川化学工業	7	7.2	8,128	
メック	5.8	5.5	22,660	
タカラバイオ	19.1	19	50,141	
J C U	8.6	8	38,400	
デクセリアルズ	19	18.9	63,220	
アース製薬	5.3	6	36,840	
北興化学工業	8.1	7.8	6,598	
大成ラミック	3.5	3.3	9,042	
クマイ化学工業	30.5	27.5	21,945	
日本農薬	16.1	16.1	7,486	
アキレス	5.9	6.2	7,495	
有沢製作所	12.6	11.7	10,822	
日東電工	49.8	44	347,600	
レック	7.5	11	9,009	
三光合成	15.3	—	—	
藤森工業	6.1	6.4	22,912	
前澤化成工業	7.1	6.8	8,506	
未来工業	4.9	3.8	6,140	
J S P	5	5.2	7,878	
エフピコ	15	13.6	50,932	
天馬	5.4	6	14,412	
信越ポリマー	12.7	13.4	12,743	
東リ	23.1	27.3	5,978	
ニフコ	26.5	24.4	76,128	
バルカー	6.6	6	14,652	
ユニ・チャーム	153.3	140.5	686,764	
医薬品（4.8%）				
協和キリン	72.6	85.3	270,401	
武田薬品工業	601.8	572.5	1,735,247	
アステラス製薬	627.6	631.5	1,123,754	
大日本住友製薬	54.3	45.3	62,604	
塩野義製薬	90.9	91.5	724,954	
あすか製薬	8	—	—	
日本新薬	19	19.1	160,440	
中外製薬	226.2	227.8	838,304	
科研製薬	12.2	11.5	46,517	
エーザイ	86.7	87.1	598,638	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
ロート製薬	37	37.5	121,312	
小野薬品工業	166.3	167	418,418	
久光製薬	19.1	19.2	76,608	
持田製薬	10.1	9.4	29,892	
参天製薬	135.1	135.8	204,243	
扶桑薬品工業	3.7	3.4	8,054	
日本ケミファ	2.2	2.5	5,102	
ツムラ	22.5	22.6	73,111	
日医工	20	23.3	15,657	
キッセイ薬品工業	12.5	13.2	30,148	
生化学工業	14.4	13	12,194	
栄研化学	12.4	12.7	24,041	
鳥居薬品	4.5	4.1	11,389	
JCRファーマ	20.8	20.7	51,729	
東和薬品	9.2	10.2	26,785	
富士製薬工業	6.8	6.3	6,804	
沢井製薬	14.8	—	—	
ゼリア新薬工業	13	13.1	25,138	
第一三共	621.1	572.5	1,617,026	
キョーリン製薬ホールディングス	16.1	14.5	24,476	
大幸薬品	9.2	12.9	10,423	
ダイト	4.6	4.8	13,636	
大塚ホールディングス	150.2	151.3	627,289	
大正製薬ホールディングス	15	17.2	95,976	
ペプチドリーム	36.7	38.4	109,900	
あすか製薬ホールディングス	—	9.2	8,850	
サワイグループホールディングス	—	16	67,200	
石油・石炭製品 (0.4%)				
日本コークス工業	99.6	69.2	8,442	
ニチレキ	9.1	10.4	13,592	
ユシロ化学工業	6.4	7	7,266	
MORESCO	—	5.4	5,815	
出光興産	80.8	80.6	236,238	
ENEOSホールディングス	1,088	1,096.1	464,088	
コスモエネルギーホールディングス	21.7	21.2	47,170	
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	41.5	41.8	73,818	
TOYO TIRE	39	38.6	66,623	
ブリヂストン	192.6	209.8	966,129	
住友ゴム工業	64	65.4	74,490	
藤倉コンポジット	—	7.4	5,831	
オカモト	4.6	4.4	16,588	
ニッタ	7.8	7.6	19,775	
住友理工	16.1	15.8	9,069	
三ツ星ベルト	10	8.9	17,194	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
バンドー化学	14.4	13	11,050	
ガラス・土石製品 (0.8%)				
日東紡績	11.1	11	29,326	
AGC	66.2	66.8	370,740	
日本板硝子	15.4	19.6	9,839	
日本山村硝子	5.4	—	—	
日本電気硝子	27.1	29.5	86,700	
オハラ	4	3.8	5,179	
住友大阪セメント	14	13.8	47,610	
太平洋セメント	45.9	41.6	91,478	
日本ヒューム	10.6	12.1	8,058	
日本コンクリート工業	22.2	22.9	5,770	
三谷セキサン	3.4	3.6	25,488	
アジアパイルホールディングス	15	16.5	6,798	
東海カーボン	71	61.2	72,032	
日本カーボン	4.2	3.8	15,751	
東洋炭素	4.9	4.8	14,928	
ノリタケカンパニーリミテド	4	4.1	18,983	
TOYO	51.7	52.1	262,063	
日本碍子	86.5	78.7	141,423	
日本特殊陶業	54.9	55.4	104,595	
MARUWA	2.8	2.6	34,840	
品川リフラクトリーズ	2.4	2	6,950	
黒崎播磨	1.8	1.6	6,240	
ヨータイ	8.2	5.4	6,539	
東京窯業	16.5	15.3	4,498	
フジミンコーポレートッド	6.7	6	44,100	
ニチアス	19	17.7	45,418	
ニチハ	10	10.2	28,468	
鉄鋼 (0.7%)				
日本製鉄	319.8	322.2	547,578	
神戸製鋼所	130.3	133.7	73,401	
中山製鋼所	13	14.9	6,153	
合同製鐵	4.7	5.2	6,832	
ジェイエフイーホールディングス	191	194	255,304	
東京製鐵	34	24.6	29,593	
共英製鋼	9.2	9.1	11,384	
大和工業	15.5	14	48,790	
東京鐵鋼	4	4.7	5,832	
大阪製鐵	4.5	—	—	
淀川製鋼所	8.9	9.6	21,888	
丸一鋼管	22.8	25.6	62,131	
モリ工業	2.7	2.6	6,692	
大同特殊鋼	11.7	11.9	46,767	
日本冶金工業	6.9	5.5	11,236	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
山陽特殊製鋼	6	7.6	13,816	
愛知製鋼	4.4	4.7	11,406	
日立金属	77	77.3	162,484	
大太平洋金属	5.6	4.9	9,947	
新日本電工	49.6	47.2	13,782	
栗本鐵工所	4.4	4.7	6,923	
三菱製鋼	8.9	5.7	5,529	
日本精線	—	1.5	6,562	
エンビプロ・ホールディングス	—	3.4	6,449	
シンニッタン	19.9	—	—	
非鉄金属（0.7%）				
大紀アルミニウム工業所	12.7	10.6	15,497	
日本軽金属ホールディングス	18.1	18.4	30,709	
三井金属鉱業	19.5	19.3	56,549	
東邦亜鉛	—	4.6	9,761	
三菱マテリアル	47.5	47.4	92,619	
住友金属鉱山	91.5	92.1	389,859	
DOWAホールディングス	18.3	19.5	82,290	
古河機械金属	12.7	11.8	14,136	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9.7	11	8,580	
東邦チタニウム	15.2	13.5	12,798	
UACJ	11	10.8	24,786	
CKサンエツ	2.1	2	6,710	
古河電気工業	22.6	22.6	50,963	
住友電気工業	267.1	269.8	401,867	
フジクラ	89.6	80.4	46,069	
昭和電線ホールディングス	8	6.4	12,019	
タツタ電線	16.3	14.9	6,868	
平河ヒューテック	—	5.4	5,950	
リョービ	9.7	10.2	10,271	
アーレスティ	15.7	—	—	
アサヒホールディングス	13.2	28.7	54,931	
金属製品（0.6%）				
稲葉製作所	5.4	—	—	
宮地エンジニアリンググループ	3.3	3.2	9,299	
トーカロ	20.8	18.4	27,305	
アルファ	4.3	4.9	5,243	
SUMCO	92	110.9	275,919	
川田テクノロジーズ	1.8	2.1	7,759	
RS Technologies	2.8	2.4	15,456	
東洋製罐グループホールディングス	46.3	46.3	64,171	
ホッカンホールディングス	4.8	5.4	7,614	
コロナ	5.9	—	—	
横河ブリッジホールディングス	13.5	12.4	26,300	
駒井ハルテック	—	3.1	5,332	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
三和ホールディングス	68	68.4	82,969	
文化シャッター	21.4	23	23,207	
三協立山	11.1	12	8,208	
アルインコ	7.9	8	7,472	
LIXIL	105.9	113.4	316,272	
ノーリツ	15	13.9	22,643	
長府製作所	7.2	7.3	14,607	
リンナイ	14	13.6	145,792	
日東精工	12.4	13	7,709	
岡部	14.7	18	12,132	
ジテクト	9.3	9.2	12,263	
東プレ	13.9	13.7	14,946	
高周波熱錬	16.2	16.3	9,013	
東京製鋼	8.2	7	5,320	
パイオラックス	10.6	11	17,710	
エイチワン	9.3	9.9	6,147	
日本発条	77.1	66.8	56,579	
立川ブラインド工業	—	5	5,450	
三益半導体工業	5.7	5.6	13,109	
機械（5.4%）				
日本製鋼所	21.5	22.2	76,035	
三浦工業	31	31.3	124,730	
タクマ	23.9	24.1	33,017	
ツガミ	14.7	17.4	24,551	
オークマ	8.2	8.5	40,332	
芝浦機械	8.2	8.3	27,971	
アマダ	88	113.4	120,544	
アイダエンジニアリング	18.4	19	17,518	
FUJII	29.9	33	82,137	
牧野フライス製作所	8.2	7.8	26,949	
オーエスジー	35.2	34	55,964	
旭ダイヤモンド工業	20.3	19.4	12,299	
DMG森精機	45.5	42.9	76,104	
ソディック	15.8	16.8	12,885	
ディスコ	9.7	10.6	345,560	
日東工器	4.5	4.8	8,352	
日進工具	3.4	6.3	9,002	
パンチ工業	11.3	—	—	
豊和工業	5.7	—	—	
島精機製作所	11	10.8	20,606	
オプトラン	9	9.3	20,859	
NCホールディングス	—	3	4,164	
イワキ	5.9	—	—	
フリーー	8.9	7.2	9,158	
ヤマシンフィルタ	15	15.4	8,054	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日阪製作所	10.6	11.3	8,904	
やまびこ	13.9	13.9	17,347	
野村マイクロ・サイエンス	—	2	9,690	
平田機工	3.3	3.5	20,895	
ペガサスミシン製造	15.3	—	—	
マルマエ	4.2	3.3	9,876	
タツモ	3.9	4.2	7,009	
ナブテスコ	42.1	41.1	135,013	
三井海洋開発	7.2	8.2	11,463	
レオン自動車	7.9	8.6	11,257	
S M C	22.7	21.3	1,547,445	
ホソカワミクロン	2.4	5.1	14,494	
ユニオンツール	2.7	2.8	10,486	
オイレス工業	8.6	10	16,430	
日精エー・エス・ビー機械	2.4	2.7	7,678	
サトーホールディングス	10.2	9.7	20,622	
技研製作所	6.2	6.4	26,432	
日本エアーテック	—	4.7	5,687	
日精樹脂工業	7.7	6.5	6,370	
小松製作所	327.4	330.5	856,656	
住友重機械工業	40.9	41.6	104,873	
日立建機	29.1	29.2	96,360	
日工	13.1	13.6	8,296	
巴工業	4	3.5	8,008	
井関農機	8.1	7.7	10,849	
T O W A	7	6.5	20,800	
北川鉄工所	4.1	4.8	6,686	
ローツェ	3.1	3.6	43,020	
クボタ	378.6	355.8	842,890	
荏原実業	2.3	3.6	9,036	
三菱化工機	3.6	3	6,795	
月島機械	13.6	13.8	14,738	
帝国電機製作所	7.3	6.1	8,485	
新東工業	16.6	18.5	12,524	
澁谷工業	6.3	6.4	18,291	
アイチ コーポレーション	12	11.8	9,192	
小森コーポレーション	17.9	20.4	12,852	
鶴見製作所	6.1	6.3	9,639	
住友精密工業	2.2	—	—	
酒井重工業	1.9	—	—	
荏原製作所	30.1	30.3	184,830	
西島製作所	10.9	10	8,630	
北越工業	9.3	9.1	8,608	
ダイキン工業	92.2	92.9	2,150,635	
オルガノ	2.6	2	13,640	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
トーヨーカネツ	4.2	3.4	8,479	
栗田工業	38.9	39.4	208,820	
椿本チエイン	9.4	9.5	27,312	
大同工業	7	5.3	4,515	
木村化工機	—	7.5	7,395	
アネスト岩田	12.6	12.8	10,931	
ダイフク	36.7	40	363,600	
サムコ	2.3	2.3	6,695	
加藤製作所	6	—	—	
タダノ	35	39	39,312	
フジテック	26.2	27.3	65,028	
C K D	20	21.4	47,572	
キトー	6.9	7.2	12,628	
平和	19.8	20.4	37,699	
理想科学工業	7.4	6.4	12,940	
S A N K Y O	16	16.1	46,593	
日本金銭機械	10.7	9.1	6,260	
マースグループホールディングス	5.7	6.2	9,858	
フクシマガリレイ	4.5	5.1	21,318	
ダイコク電機	5.8	5	5,950	
竹内製作所	12.1	11	29,898	
アミノ	19	19.3	48,076	
J U K I	13.2	11.8	10,844	
ジャノメ	—	8.1	5,038	
マックス	11	9.9	17,770	
グローリー	18.7	19.2	39,840	
新晃工業	7.5	7	12,817	
大和冷機工業	11.5	10.5	12,663	
セガサミーホールディングス	71.9	72.5	133,762	
日本ピストンリング	4.4	4.4	5,363	
リケン	3.9	3.7	9,016	
T P R	9.8	10	13,680	
ツバキ・ナカシマ	13.5	16.5	22,605	
ホンザキ	22.8	21.3	183,606	
大豊工業	8.2	8.2	5,969	
日本精工	133.9	136.1	104,933	
N T N	170.5	157.9	33,159	
ジェイテクト	68.2	69.6	69,043	
不二越	6.5	6.1	23,546	
日本トムソン	25.8	22.1	15,271	
T H K	45	42.5	115,217	
ユースン精機	8	8.7	6,333	
前澤給装工業	3.6	7.3	7,307	
イーグル工業	9.6	10	10,250	
日本ビラー工業	7.9	7.4	23,680	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
キッツ	28.2	25.3	17,735	
マキタ	94.1	88.9	443,077	
日立造船	56	61.6	51,805	
三菱重工	121	114.6	293,490	
IHI	52.6	45.6	97,629	
スター精密	11.3	11.6	16,773	
電気機器（19.8%）				
日清紡ホールディングス	45.1	44.9	36,773	
イビデン	44.4	38.2	270,074	
コニカミノルタ	160	160.3	75,180	
ブラザー工業	88	88.8	173,515	
ミネベアミツミ	133.9	125.2	375,600	
日立製作所	347.7	350.5	2,344,144	
東芝	—	127.3	576,287	
三菱電機	722.9	729	1,038,460	
富士電機	43.6	43.9	260,766	
東洋電機製造	4.2	—	—	
安川電機	77.7	78.3	398,547	
シンフォニアテクノロジー	10.2	9.5	11,979	
明電舎	13.9	12.6	32,608	
オリジン	3.6	4.3	5,426	
山洋電気	3.5	3.3	18,711	
デンヨー	6.5	7	11,599	
PHCホールディングス	—	8	18,384	
東芝テック	9.1	7.9	34,404	
芝浦メカトロニクス	1.8	1.4	11,550	
マブチモーター	19.9	17.1	63,783	
日本電産	174.1	188.9	2,455,700	
トレックス・セミコンダクター	5.9	4.2	15,897	
東光高岳	5.8	5.2	6,780	
ダイヘン	7.8	8	34,400	
ヤーマン	12.4	12.4	12,499	
JVCケンウッド	—	65.9	10,873	
ミマキエンジニアリング	11.9	8.5	7,497	
IPEX	4.2	4.1	7,954	
日新電機	16.8	17.2	24,372	
大崎電気工業	18	18	7,938	
オムロン	64.6	60.7	665,575	
日東工業	10.5	9.8	14,572	
IDEC	11.2	9.4	25,267	
ジーエス・ユアサコーポレーション	24.7	24.4	56,266	
メルコホールディングス	3	2.2	8,580	
日本電気	87.8	92.5	473,600	
富士通	69.7	65.6	1,232,952	
沖電気工業	29	31.1	26,061	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
電気興業	4	4.4	11,079	
サンケン電気	8	6.9	39,882	
アイホン	5.1	4.7	9,808	
ルネサスエレクトロニクス	311.1	394.7	569,157	
セイコーエプソン	90.1	90.5	165,615	
ワコム	48.6	56.5	49,381	
アルバック	13.6	13.5	87,750	
EIZO	5.8	5.7	22,458	
日本信号	18.9	19.1	16,445	
京三製作所	19.7	18.7	8,059	
能美防災	9.6	9.9	19,790	
ホーチキ	6.2	6.5	8,099	
エレコム	8.4	16.8	22,260	
パナソニック	826.1	777.6	966,168	
シャープ	84.4	83.3	105,791	
アンリツ	47	46.9	82,778	
富士通ゼネラル	19.9	19.9	51,342	
ソニーグループ	453.1	456.5	6,311,112	
TDK	34.9	105.5	474,750	
帝国通信工業	5.5	5	6,125	
タムラ製作所	26.3	29.1	20,049	
アルプスアルパイン	64	65.1	66,597	
日本電波工業	—	8.2	13,808	
メイコー	—	6	23,220	
日本トリム	1.6	2.1	7,056	
ローランド ディー・ジー	5.8	4.8	12,403	
フォスター電機	9.1	9.8	6,889	
SMK	2.5	2.5	5,702	
ヨコオ	5	5.5	14,762	
ホシデン	20.2	17.4	20,427	
ヒロセ電機	11.1	11.2	213,360	
日本航空電子工業	17.1	17	30,855	
TOA	9.6	9.8	7,105	
マクセル	16.4	15	19,635	
古野電気	10.5	9.6	11,001	
ユニデンホールディングス	3	2.1	7,035	
スミダコーポレーション	8	7.9	8,863	
アイコム	4.2	3.4	7,854	
リオン	3.8	3.6	7,686	
船井電機	12.9	—	—	
横河電機	66.7	73.1	156,068	
新電元工業	3.3	3.1	10,478	
アズビル	45.5	42.7	214,354	
東亜ディーケーケー	5.5	5.4	4,536	
日本光電工業	30.3	29.9	100,015	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
チノー	4.2	—	—	—
共和電業	15.2	16.2	6,285	—
日本電子材料	—	4	8,776	—
堀場製作所	14.5	13.4	90,450	—
アドバンテスト	53.7	54.1	540,459	—
エスベック	6.9	6.2	13,038	—
キーエンス	65.5	66	4,641,780	—
日置電機	3.5	3.5	31,010	—
シスメックス	51.7	61.6	872,256	—
日本マイクロニクス	12.1	13.1	23,501	—
メガチップス	7	6.9	32,809	—
OBARA GROUP	4.4	3.7	12,284	—
コーセル	11.7	10.6	9,518	—
イリソ電子工業	6.1	6.3	28,822	—
オプテックスグループ	12.6	12.7	18,859	—
千代田インテグレ	4.5	4	8,676	—
レーザーテック	31.7	32	951,840	—
スタンレー電気	50.9	50.9	150,256	—
岩崎電気	4.1	3.6	8,085	—
ウシオ電機	40.9	37.6	79,223	—
ハリオス テクノ ホールディング	13.3	—	—	—
日本セラミック	7.7	6.9	19,747	—
遠藤照明	—	4.8	4,910	—
古河電池	6.2	5.6	8,192	—
山一電機	6.3	6.1	14,060	—
図研	5.1	4.8	17,928	—
日本電子	14.6	15.2	143,944	—
カシオ計算機	64.5	53	78,122	—
ファナック	68	64	1,423,680	—
日本シイエムケイ	20.8	18.2	9,172	—
エンプラス	4.6	2.2	5,546	—
大真空	—	11.6	18,212	—
ローム	30.0	32.6	346,538	—
浜松ホトニクス	51.7	52.2	364,356	—
三井ハイテック	8.5	7.2	65,952	—
新光電気工業	24.7	21.3	113,955	—
京セラ	101.9	102.6	690,600	—
太陽誘電	32.3	35.3	220,978	—
村田製作所	212.5	214	1,793,320	—
双葉電子工業	12.9	14.5	9,990	—
北陸電気工業	5.7	6.1	7,722	—
ニチコン	25.3	23.1	26,842	—
日本ケミコン	—	7.3	13,147	—
KOA	11.6	11.2	17,136	—
市光工業	12.8	10.7	5,307	—

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
小糸製作所	43.1	39.9	260,547	—
ミツバ	—	15.6	7,160	—
SCREENホールディングス	12.6	12.7	146,050	—
キャノン電子	7.6	7.7	11,442	—
キャノン	359	362	905,000	—
リコー	184.7	202.3	202,906	—
象印マホービン	19.9	19.7	31,342	—
東京エレクトロン	45.9	46.2	2,764,608	—
輸送用機器 (8.1%)				
トヨタ紡織	21.3	29.6	66,274	—
ユニプレス	14.6	12.6	8,946	—
豊田自動織機	58.1	58.9	548,948	—
モリタホールディングス	12.7	12.4	15,785	—
三櫻工業	11.1	11.1	10,400	—
デンソー	159.2	160.5	1,337,125	—
東海理化電機製作所	19	19.3	28,641	—
川崎重工業	56.5	53.2	101,505	—
名村造船所	29.6	—	—	—
日本車輛製造	3.4	3.6	7,228	—
三菱ロジスネクスト	10.7	10.6	10,886	—
日産自動車	851.4	859.2	483,643	—
いすゞ自動車	209.5	228.5	350,062	—
トヨタ自動車	807.1	3,691.1	7,385,891	—
日野自動車	90	91.5	86,376	—
三菱自動車工業	270.9	269.9	98,783	—
エフテック	8.8	—	—	—
武蔵精密工業	16	16.4	29,060	—
日産車体	14.4	12.7	8,585	—
新明和工業	19	20.3	17,153	—
極東開発工業	13.5	13.4	18,786	—
トビー工業	7.2	7.9	8,302	—
ティアラド	4.1	2.5	7,137	—
曙ブレーキ工業	—	44.8	8,691	—
タチエス	11.9	13.3	15,215	—
NOK	39	36	43,704	—
フタバ産業	21.3	20.8	8,008	—
KYB	8.2	7.5	21,780	—
大同メタル工業	18.3	18.4	10,451	—
プレス工業	40.5	39.7	14,808	—
太平洋工業	15.3	15.6	16,395	—
河西工業	13.4	—	—	—
アイシン	59.3	53.1	221,427	—
マツダ	213.5	228.8	210,038	—
今仙電機製作所	8.9	—	—	—
本田技研工業	569.4	573.8	1,779,353	—

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末 評価額
	株数	株数	
スズキ	143.4	166.5	763,402
S U B A R U	224.4	208.7	447,139
安永	4.5	5	4,815
ヤマハ発動機	102.1	95	271,605
T B K	13.1	14.5	5,698
エクセディ	10.2	10.9	17,549
豊田合成	23.4	23.5	53,321
愛三工業	14.6	13.4	10,197
日本プラスト	8.8	—	—
ヨロズ	8.9	8.9	9,380
エフ・シー・シー	12	11.8	16,944
シマノ	27.1	29.4	923,160
テイ・エス テック	16.6	30.8	41,056
ジャムコ	6.7	6.3	5,210
精密機器 (3.0%)			
テルモ	204.5	206.3	954,756
日機装	23.8	21.7	18,401
日本エム・ディ・エム	5	4.7	9,099
島津製作所	86.1	93.5	449,735
J M S	8.3	8.1	4,779
長野計器	7.4	5.9	9,976
ブイ・テクノロジー	3.5	3.4	11,713
東京計器	6.4	6.8	6,589
インターアクション	4.6	3.9	9,067
東京精密	13.2	12.2	58,560
マニー	28.9	29.6	49,136
ニコン	110.8	111.7	131,470
トプコン	37.2	34.7	62,147
オリンパス	400.4	382.7	971,675
理研計器	6.2	5.7	30,609
タムロン	6.4	5.7	14,381
H O Y A	143.6	142.3	2,564,246
ノーリツ鋼機	5.6	6.7	18,378
エー・アンド・デイ	9.1	7.6	8,496
朝日インテック	82	80.1	199,288
シチズン時計	80	83.8	43,492
リズム	—	3.4	4,046
メニコン	10.1	24	90,120
松風	4.3	3.6	7,297
セイコーホールディングス	9.6	10.1	22,199
ニプロ	51.4	55.6	59,770
その他製品 (2.2%)			
スノーピーク	5.8	9.6	37,200
パラマウントベッドホールディングス	7.5	14	27,034
トランザクション	6	5.5	5,318

銘柄	期首(前期末)		期末 評価額
	株数	株数	
ニホンフラッシュ	7.6	7.2	7,668
前田工織	7.7	8	28,080
永大産業	15.6	20.5	5,576
アートネイチャー	10.6	9.3	6,007
バンドイナムコホールディングス	74.6	65.3	577,056
S H O E I	6.2	7.2	34,560
フランスベッドホールディングス	12.5	12.4	10,577
パイロットコーポレーション	12.6	12.7	52,641
萩原工業	5.2	5.8	7,690
トッパン・フォームズ	14.8	—	—
フジールインターナショナル	15.9	17.7	36,426
タカラトミー	32.1	31	30,969
広済堂ホールディングス	8.8	5.4	4,422
プロネクサス	7.6	7.6	7,714
大建工業	5.5	4.6	9,926
凸版印刷	100.6	110.4	190,219
大日本印刷	94.3	86	229,018
共同印刷	2.9	3.1	8,559
N I S S H A	14.6	15.2	23,985
TAKARA & COMPANY	4.5	4.8	8,308
アシックス	63.5	64.7	182,324
ローランド	—	5.2	22,516
小松ウオール工業	3.1	—	—
ヤマハ	42.9	43.3	252,006
河合楽器製作所	2.8	2.4	7,704
クリナップ	9.3	—	—
ピジョン	46.4	44.3	101,934
オリバー	2	—	—
キングジム	8.2	8.4	7,165
リンテック	17	15.8	39,500
イトーキ	20	19.7	6,737
任天堂	44.4	41.2	2,064,120
三菱鉛筆	11.5	12.1	14,677
タカラスタンダード	13.2	16.4	22,402
コクヨ	34.1	35.1	58,125
ナカバヤシ	9.9	11.4	5,688
グローブライド	3.1	6.5	22,490
オカムラ	24.5	26.7	34,042
美津濃	6.3	7.4	15,769
電気・ガス業 (1.1%)			
東京電力ホールディングス	572.3	545.7	165,347
中部電力	221.4	221	253,266
関西電力	273.6	275.5	282,938
中国電力	104.5	113.7	101,306
北陸電力	66	68.2	38,396

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
東北電力	179.1	168	132,048	
四国電力	66.2	66.5	50,207	
九州電力	147.7	147.8	119,865	
北海道電力	68.7	64.2	30,109	
沖縄電力	14.5	15.5	21,529	
電源開発	57.4	62.1	89,734	
エフオン	—	6.4	4,192	
イーレックス	10	10.9	27,882	
レノバ	12.6	14.2	75,970	
東京瓦斯	139.1	139.3	270,938	
大阪瓦斯	139.9	131.1	239,519	
東邦瓦斯	35.5	33.4	107,047	
北海道瓦斯	5.8	5.5	8,090	
広島ガス	22.7	20.4	7,160	
西部ガスホールディングス	8.4	8.4	17,808	
静岡ガス	20.3	18.8	18,198	
メタウォーター	7.4	8.5	16,575	
陸運業 (3.0%)				
SBSホールディングス	5.4	5.2	18,018	
東武鉄道	74.7	70.3	180,319	
相鉄ホールディングス	23.3	23.7	46,807	
東急	180.7	182.9	287,335	
京浜急行電鉄	92.1	93.3	104,682	
小田急電鉄	106.9	107.7	235,539	
京王電鉄	37.3	37.7	192,647	
京成電鉄	50.1	50.7	157,677	
富士急行	10	8.8	36,124	
新京成電鉄	3.3	3.5	6,895	
東日本旅客鉄道	127.6	128.4	897,002	
西日本旅客鉄道	64.7	88.4	432,983	
東海旅客鉄道	60.2	60.7	946,920	
西武ホールディングス	94.5	95.6	103,726	
鴻池運輸	11.6	11.9	12,959	
西日本鉄道	19.9	20.5	52,152	
ハマキョウレックス	5.8	5.2	14,820	
サカイ引越センター	3.9	3.3	13,843	
近鉄グループホールディングス	68.1	68.4	222,984	
阪急阪神ホールディングス	90.9	85.7	288,380	
南海電気鉄道	33	31.5	64,008	
京阪ホールディングス	30.3	30.8	78,478	
神戸電鉄	2.3	2.8	8,974	
名古屋鉄道	55.7	56.5	93,790	
山陽電気鉄道	6	6.7	12,931	
日本通運	23.6	23.8	153,986	
ヤマトホールディングス	113	96.6	241,886	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
山九	19.1	19.1	86,141	
丸全昭和運輸	5.9	5.7	18,040	
センコーグループホールディングス	37.8	33.2	30,743	
トナミホールディングス	1.9	1.9	6,688	
ニッコンホールディングス	24.7	23.7	46,997	
福山通運	8.8	11.2	42,112	
セイノーホールディングス	51	46.6	53,450	
神奈川中央交通	2.3	2.5	8,050	
日立物流	12.8	13.6	62,968	
丸和運輸機関	7.3	14.3	19,734	
C&Fロジホールディングス	7.5	7.8	11,715	
九州旅客鉄道	60.2	53.7	128,611	
S Gホールディングス	143.8	130.4	327,304	
海運業 (0.4%)				
日本郵船	58.2	57.5	425,500	
商船三井	44.3	38.1	247,650	
川崎汽船	14.3	21.3	103,731	
N Sユナイテッド海運	5.5	4	12,920	
明治海運	—	9.3	6,379	
飯野海運	39.1	33	17,061	
乾汽船	8.1	5.3	10,647	
空運業 (0.4%)				
日本航空	152.2	158.6	326,081	
A N Aホールディングス	125.8	175.6	393,256	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
トランコム	2	2	16,100	
日新	6.7	6.3	9,594	
三菱倉庫	22	22.1	61,305	
三井倉庫ホールディングス	8.4	7.5	17,100	
住友倉庫	22.8	23.7	43,062	
澁澤倉庫	4.5	4.6	9,646	
東陽倉庫	20.9	19.9	6,069	
日本トランスシティ	18	16.4	9,085	
川西倉庫	4	3.5	3,734	
安田倉庫	7.6	7.4	6,882	
東洋埠頭	4.9	5.9	8,301	
上組	36.9	37.3	78,292	
近鉄エクスプレス	14.5	12.7	34,645	
エアイティー	8	5.9	6,720	
内外トランスライン	—	3.2	5,843	
日本コンセプト	4.3	3	4,932	
情報・通信業 (8.6%)				
N E C ネットエスアイ	20.3	23.2	41,968	
システナ	25.5	101.2	47,766	
デジタルアーツ	3.6	3.9	36,777	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日鉄ソリューションズ	10.6	10.1	34,744	
キューブシステム	5.4	—	—	
コア	4.1	4	6,120	
ラクーンホールディングス	—	6	9,198	
ソリトンシステムズ	4.5	5	5,985	
ソフトクリエイトホールディングス	3.4	3.3	14,470	
T I S	71.5	68.1	239,031	
電算システム	3.3	—	—	
グリ	45.6	44.1	44,011	
ユーエーテックモホールディングス	14.7	22.8	108,414	
三菱総合研究所	3.2	3.1	11,501	
ファインデックス	8	8.7	8,821	
ブレインパッド	2.1	2	11,280	
K L a b	14.8	15.4	8,562	
ポルトゥウィン・ビット クルーホールディングス	10.6	11.6	11,182	
ネクソン	179.5	161.4	363,795	
アイスタイル	—	26	7,150	
エムアップホールディングス	2.5	2.3	9,890	
エイチーム	7.8	5.9	6,242	
エニグモ	7.7	8.9	8,677	
コロブラ	24.9	24.4	16,909	
ブロードリーフ	36.7	37.1	17,808	
デジタルハーツホールディングス	6.1	4.2	10,407	
システム情報	6.3	7	6,160	
メディアドゥ	2.5	2.7	12,352	
じげん	23.9	25.2	7,786	
ブイキューブ	4.7	7.8	8,853	
フィックスターズ	9.3	10.6	8,808	
CARTA HOLDINGS	4.8	3.5	7,455	
オブティム	4.3	6	8,622	
セレス	3.5	3	6,756	
SHIFT	3	3.6	91,152	
ティーガイア	6.1	7	11,312	
セック	1.6	—	—	
テクマトリックス	10.6	12.6	24,633	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17.8	19.8	60,192	
GMOペイメントゲートウェイ システムリサーチ	15.1	13.9	211,697	
	2.9	3.1	5,660	
インターネットイニシアティブ	10.9	19.1	92,826	
さくらインターネット	10.9	12.8	6,796	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1.7	1.8	7,191	
S R Aホールディングス	4.8	4.2	11,583	
e B A S E	9.8	10.2	6,568	
アバント	7.8	8.3	11,130	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
アドソル日進	3.4	3.7	6,319	
フリービット	6.2	5.3	6,466	
コムチュア	8.3	8	28,280	
アステリア	6.4	7.9	6,343	
アイル	4.6	4.4	6,824	
マークライNZ	4.1	4.1	10,856	
メディカル・データ・ビジョン	8.7	10	13,290	
g u m i	10.9	11	8,976	
モバイルファクトリー	2.8	—	—	
テラスカイ	2.9	3.3	6,761	
デジタル・インフュージョン・テクノロジー	4.6	4.3	5,981	
P C Iホールディングス	—	5.9	6,726	
P R T I M E S	—	1.7	5,414	
ラクス	—	24.7	75,829	
ダブルスタンダード	1.3	2.4	8,988	
オープンドア	5.3	4.7	8,586	
アカツキ	2.8	3.5	9,583	
U b i c o mホールディングス	2.3	2.5	7,150	
L I N E	14.8	—	—	
カナミックネットワーク	8.1	10.6	5,204	
チェンジ	5.1	13.2	27,852	
オークネット	5.8	4.5	7,587	
A O I T Y O H O L D I N G S	11.2	—	—	
マクロミル	17.1	17.5	16,082	
オロ	2.8	2.6	8,840	
ユーザーローカル	—	3.4	5,528	
マネーフォワード	—	10.9	85,238	
電算システムホールディングス	—	3.3	7,441	
ソルクシーズ	4.7	—	—	
プロトコーポレーション	8.4	8.6	10,930	
野村総合研究所	100.7	138.1	673,928	
サイバネットシステム	8	—	—	
インテージホールディングス	11.1	9.3	16,284	
ソースネクスト	39.3	37.9	7,011	
インフォコム	7.9	8.1	15,462	
シンプレクス・ホールディングス	—	7.4	20,646	
H E R O Z	1.2	2.4	3,456	
ラクスル	6.1	7.9	49,454	
I P S	—	2.7	5,459	
イーソル	—	6.5	4,329	
アルテリア・ネットワークス	9	9.8	15,082	
ウイングアーク1 s t	—	4.7	9,870	
サーバーワークス	—	1.4	5,110	
S a n s a n	—	25.6	80,128	
ギフティ	—	6.5	16,848	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ベース	—	1.5	6,262	
フォーカスシステムズ	6.9	7.2	7,365	
クレスコ	5.9	6.1	11,712	
フジ・メディア・ホールディングス	67.5	69.2	78,057	
オービック	24.6	22.5	472,275	
ジャストシステム	11.6	10.2	52,938	
TDCソフト	7.4	7.4	8,828	
Zホールディングス	976.3	1,040.9	782,756	
トレンドマイクロ	38.2	38.3	250,865	
IDホールディングス	3.9	—	—	
日本オラクル	14.5	14.6	162,936	
アルファシステムズ	2.7	2.1	8,001	
フューチャー	9	7.4	30,007	
CAC Holdings	6.1	5.3	7,934	
S Bテクノロジー	3	3.6	9,705	
オービックビジネスコンサルタント	7.3	6.8	34,680	
伊藤忠テクノソリューションズ	32.4	32.5	120,087	
アイティフォー	10.9	10.4	8,236	
大塚商会	38.4	38.6	200,334	
サイボウズ	8.9	9.8	21,197	
電通国際情報サービス	4.5	10.2	37,536	
ACCESS	9	10.5	8,011	
デジタルガレージ	13	11.9	59,262	
イーエムシステムズ	12.2	14.8	10,286	
ウェザーニューズ	2.6	2.2	21,164	
C I J	7.1	7.3	5,876	
WOWOW	3.8	4	8,136	
スカラ	7.7	10.3	6,262	
IMAGICA GROUP	10.1	7.3	5,745	
ネットワンシステムズ	27.4	27.3	93,093	
アルゴグラフィックス	6.2	5.7	16,193	
マーベラス	14.1	14.3	10,238	
エイベックス	13.5	13	22,035	
日本ユニシス	22.5	22.5	73,800	
兼松エレクトロニクス	3.9	3.9	14,040	
都築電気	—	4.4	7,576	
TBSホールディングス	43.1	43.7	74,945	
日本テレビホールディングス	58.4	59.8	68,770	
朝日放送グループホールディングス	10.6	10.9	7,433	
テレビ朝日ホールディングス	19.5	17.6	26,259	
スカパーJ SATホールディングス	49.2	60.7	24,583	
テレビ東京ホールディングス	5.9	5.8	11,756	
ビジョン	10.8	12.7	16,751	
USEN-NEXT HOLDINGS	3.8	7	22,645	
コネクシオ	5	5.7	8,019	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本通信	39.5	—	—	
日本電信電話	948.9	836.5	2,614,062	
KDDI	517.3	521.6	1,721,280	
ソフトバンク	645	1,083.9	1,693,593	
光通信	7.3	8.4	138,264	
NTTドコモ	144.7	—	—	
エムティーアイ	10.3	10.4	6,073	
GMOインターネット	26	25.7	73,450	
ファイバーゲート	—	3.4	3,668	
KADOKAWA	19.6	21	126,420	
学研ホールディングス	9.9	11.1	10,855	
ゼンリン	15.1	13.6	12,716	
アイネット	5.2	5.8	7,540	
松竹	4.8	4.9	53,704	
東宝	41.9	42.2	213,110	
東映	2.6	2.3	42,780	
エヌ・ティ・ティ・データ	188.9	190	454,860	
ピー・シー・エー	1.6	4.9	7,168	
ビジネスブレイン太田昭和	—	3.3	6,481	
DTS	15.5	13.1	31,007	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30.5	33.3	197,469	
シーイーシー	8.2	8.8	10,929	
カブコン	33.7	67.4	190,674	
アイ・エス・ビー	—	4.7	4,761	
ジャステック	6.1	5.9	6,006	
SCSK	16.5	49.6	106,888	
日本システムウエア	3.1	3.3	7,101	
アイネス	8.1	7.6	10,564	
TKC	5.9	11.9	39,151	
富士ソフト	7.6	7.6	40,128	
NSD	23.2	22.8	48,267	
コナミホールディングス	25.9	26.1	151,641	
福井コンピュータホールディングス	3.3	3.7	14,134	
JBCホールディングス	6.2	5.9	10,401	
ミロク情報サービス	7	7.6	11,126	
ソフトバンクグループ	563.2	429.1	2,587,473	
卸売業（5.1%）				
伊藤忠食品	2.1	2	9,810	
エレマテック	8.6	7	7,063	
JALUX	3.5	—	—	
あらた	5.6	5.6	21,560	
トーマンデバイス	—	1.2	8,064	
東京エレクトロニクス デバイス	3.4	2.1	14,217	
フィールズ	11.1	10	5,320	
双日	393.1	78.9	126,713	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
アルフレッサ ホールディングス	79.2	79.7	122,578	
横浜冷凍	18.8	21.5	17,264	
アルコニックス	8	7.9	9,282	
神戸物産	49	55.7	238,396	
あい ホールディングス	10.2	10.6	20,542	
ダイワボウホールディングス	6	34.8	62,953	
マクニカ・富士エレホールディングス	17.4	16.9	43,230	
ラクト・ジャパン	3.2	2.8	6,540	
グリムス	—	3.3	8,332	
バイタルケ-エスケ-ホールディングス	14	14.7	11,245	
八洲電機	8.8	8.4	7,560	
レスターホールディングス	7.8	6.6	12,223	
ジュートックホールディングス	3.2	3.1	3,202	
TOKAIホールディングス	37.2	33.6	27,753	
三洋貿易	8.9	8.9	8,624	
ビューティガレージ	—	1.5	5,602	
ウイン・パートナーズ	6.5	5.6	5,264	
シップヘルスケアホールディングス	11.4	22.9	57,937	
コメダホールディングス	15.5	16.3	31,687	
アセンテック	—	3.7	4,317	
フルサト・マルカホールディングス	—	7.1	14,192	
ヤマエグループホールディングス	—	6.2	6,218	
小野建	7.5	7.3	11,475	
佐鳥電機	7.6	6.2	5,772	
伯東	5.7	4.8	10,680	
コンドートック	7.7	7.6	7,296	
ナガイレーベン	9.3	9.8	22,951	
三菱食品	6.9	6.4	17,216	
松田産業	6.5	5.3	14,315	
第一興商	10.5	13.9	49,762	
メディバルホールディングス	76.4	77.1	157,284	
S P K	5.4	5.3	6,890	
萩原電気ホールディングス	3.5	3.5	6,972	
アズワン	4.7	5.1	71,655	
尾家産業	3.6	5	5,230	
シモジマ	6	6.3	6,797	
ドウシシャ	6.9	7.5	11,010	
高速	5.6	5.2	7,659	
丸文	—	8.6	7,361	
ハビネット	7.3	6.9	9,860	
日本ライフライン	21.6	21.9	23,170	
タカショー	—	7.4	5,291	
マルカ	3.8	—	—	
I D O M	19.1	22.5	15,502	
進和	5.4	5	9,700	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ダイترون	4.3	3.6	7,250	
シークス	9.5	11.1	14,774	
オーハシテクニカ	5.6	5.4	7,932	
白銅	—	2.8	6,594	
伊藤忠商事	498.4	501.7	1,635,542	
丸紅	742.5	706.9	719,270	
長瀬産業	39.4	39.2	65,973	
蝶理	5.4	4.8	8,217	
豊田通商	79.1	71.9	356,264	
三共生興	16.4	12.8	7,001	
兼松	26.5	25.5	31,390	
三井物産	616.9	557	1,424,249	
日本紙パルプ商事	3.9	3.9	13,942	
カメイ	9.9	8.8	8,729	
スターゼン	2.6	5.9	10,879	
山善	26.7	28.6	27,799	
椿本興業	1.9	1.8	6,984	
住友商事	449.3	452.5	699,565	
内田洋行	2.8	3.2	14,832	
三菱商事	467.2	537.7	1,823,340	
第一実業	3.5	3.3	16,137	
キャノンマーケティングジャパン	17.9	17.7	38,940	
西華産業	6.2	5.2	7,836	
佐藤商事	7.7	6.9	7,334	
菱洋エレクトロ	7.2	5.4	12,144	
東京産業	10.5	8.5	6,281	
ユアサ商事	6.6	6.6	18,460	
神鋼商事	2.7	2	6,290	
阪和興業	13.3	14.1	43,287	
正栄食品工業	4.8	4.6	17,365	
カナデン	7.4	7.7	7,592	
菱電商事	6.5	6.5	10,900	
フルサト工業	5	—	—	
岩谷産業	18.7	17.1	97,983	
ナイス	—	3	4,836	
極東貿易	3.3	2.7	6,296	
アステナホールディングス	12.9	12.1	5,880	
三菱石油	17.4	17.7	20,956	
稲畑産業	14.9	14.7	22,476	
G S I クレオス	—	5.4	5,513	
明和産業	10	7	5,733	
ヤマエ久野	6.8	—	—	
ワキタ	15.4	15.6	16,005	
東邦ホールディングス	23	23	38,916	
サンゲツ	20.1	20.2	30,683	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ミツウロコグループホールディングス	10.8	10.9	12,698	
シナネンホールディングス	3.8	3	10,260	
伊藤忠エネクス	15.1	14.9	14,169	
サンリオ	20	22.6	56,025	
サンワテクノス	7	5.1	8,542	
リョーサン	7.9	8.1	17,074	
新光商事	13.8	12.7	11,087	
トーヨー	4.7	5.2	7,150	
三信電気	5.1	4.4	6,138	
東陽テクニカ	9.6	8.7	9,369	
モスフードサービス	9.6	9.4	28,717	
加賀電子	6.7	6.5	19,058	
ソーダニッカ	12	10.9	7,368	
立花エレテック	6	6.2	9,417	
PAL TAC	11.4	10.1	44,490	
太平洋興発	7.5	7.7	4,550	
西本Wismettacホールディングス	2.8	2	6,440	
コーア商事ホールディングス	—	7.7	4,566	
国際紙パルプ商事	24.7	17.8	5,535	
ヤマタネ	6.5	4.7	7,125	
日鉄物産	4.5	4.9	22,564	
泉州電業	3	2.2	10,098	
トラスコ中山	16.3	14.5	38,149	
オートボックスセブン	27	24.8	32,463	
モリト	9.7	9.5	6,089	
加藤産業	9.6	9.7	30,749	
イノテック	6	5.5	7,447	
イエローハット	13.9	12.2	18,910	
J Kホールディングス	8.5	6.8	7,004	
日伝	6.8	6	13,080	
杉本商事	4.7	4.2	8,778	
因幡電機産業	19.6	18.6	45,737	
東テク	3.1	3	6,975	
ミスミグループ本社	89.2	90	430,650	
タキヒヨー	3.8	3.8	6,422	
スズケン	30.4	28.2	86,997	
ジェコス	7	7.5	5,760	
小売業（4.2%）				
ローソン	18.3	15.9	88,086	
サンエー	5.4	5	19,950	
カワチ薬品	5.6	5.9	12,738	
エービーシー・マート	11	11.1	59,274	
アスクル	7.4	11.9	16,886	
ゲオホールディングス	13.2	10.2	12,127	
アダストリア	10.4	7.9	14,717	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
くら寿司	4.3	7.5	28,050	
キャンドウ	5	3.9	9,028	
パルグループホールディングス	8.7	7	10,822	
エディオン	30.8	30.8	30,769	
サーラコーポレーション	16.4	16.5	9,388	
ハローズ	2.8	3.4	8,999	
フジオフードグループ本社	7.5	7.9	10,617	
あみやき亭	2.3	2.7	7,749	
ひらまつ	26.9	—	—	
大黒天物産	2.1	2.4	14,688	
ハニーズホールディングス	7.5	7.1	7,100	
アルベン	5.9	5.7	12,391	
クオールホールディングス	10.2	9.3	12,843	
ジンスホールディングス	3.8	5	32,250	
ビックカメラ	42.1	41.5	38,885	
DCMホールディングス	41.7	43.3	45,508	
Monotaro	50.8	90.9	205,070	
アークランドサービスホールディングス	6.5	6.1	13,749	
J. フロント リテイリング	85.8	86.3	80,431	
ドール・日レスホールディングス	9.5	12.2	18,507	
マツキヨココカラ&カンパニー	29.2	44	195,800	
ブロンコビリー	4.3	5.1	11,617	
Z O Z O	49.7	49.6	179,304	
物語コーポレーション	1.9	3.8	27,550	
ココカラファイン	7.3	—	—	
三越伊勢丹ホールディングス	123.9	125.5	97,388	
Hamee	3.6	—	—	
ウエルシアホールディングス	42.3	37.9	152,547	
クワイエットSDホールディングス	11.7	10.2	31,824	
チムニー	3.5	4.8	5,899	
シュッピン	7.6	7.1	6,908	
オイシックス・ラ・大地	7.1	10.3	34,402	
ネクステージ	12.8	14.4	32,976	
ジョイフル本田	20.2	20.1	31,356	
鳥貴族ホールディングス	3.4	3.6	5,958	
ホットランド	7.5	7.6	9,880	
すかいらーくホールディングス	80.6	93.1	136,763	
SFPホールディングス	5.4	5.1	6,635	
綿半ホールディングス	6.8	7	8,505	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20	19.4	19,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	5	5,045	
B E E N O S	4.3	4	10,928	
あさひ	5.8	6.3	8,089	
日本調剤	5.4	5.2	6,588	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
コスモス薬品	6.3	7.2	126,792	
セブン&アイ・ホールディングス	278.8	280.9	1,279,218	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	40.3	38.8	26,384	
ツルハホールディングス	15.5	15.6	199,680	
サンマルクホールディングス	6.3	7.7	10,841	
トリドールホールディングス	18.1	17.7	42,851	
TOKYO BASE	9.8	8.3	5,552	
JMホールディングス	5.7	5.6	9,643	
アレンザホールディングス	—	6.4	6,534	
串カツ田中ホールディングス	—	2.5	4,832	
パロックジャパンリミテッド	8.4	7.7	6,344	
クスリのアオキホールディングス	6.4	7.2	51,768	
力の源ホールディングス	4.5	—	—	
FOOD & LIFE COMPANIES	39.3	42	202,650	
メディカルシステムネットワーク	9.8	8.6	5,332	
ノジマ	12.8	11.5	25,587	
カッパ・クリエイト	10.8	11.3	14,995	
良品計画	95	82.7	151,754	
アドヴァングループ	11.5	9.4	8,300	
アルビス	3.6	3.3	6,976	
コナカ	18.7	—	—	
G-7ホールディングス	4.5	8.1	13,397	
イオン北海道	12.1	13.2	17,608	
コジマ	14.6	13.4	7,450	
コーナン商事	10.3	10.3	34,196	
エコス	3.2	3.3	5,768	
ワタミ	10.1	10.4	8,840	
パン・パシフィック・インター ナショナルホールディングス	156.8	143.5	277,816	
西松屋チェーン	16.4	15.7	23,502	
ゼンショーホールディングス	34.3	35.4	91,367	
幸楽苑ホールディングス	6.1	6.8	9,608	
サイゼリヤ	10.8	10.9	31,893	
V Tホールディングス	33.2	27.9	11,745	
フジ・コーポレーション	3	5.6	6,518	
ユナイテッドアローズ	8.2	7.8	14,843	
ハイデイ日高	9.7	10.3	16,181	
コロワイド	22	30.2	45,964	
ピーシーデポコーポレーション	12.8	—	—	
壱番屋	5	5.2	23,062	
スキホールディングス	14.3	14.4	102,816	
薬王堂ホールディングス	3.6	3.9	8,338	
スクロール	14.3	11.9	9,127	
ヨンドシーホールディングス	7.5	7.6	12,122	
木曽路	8.7	10	20,880	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
SRSホールディングス	12	14.6	10,833	
千趣会	17.8	17.9	6,945	
リテールパートナーズ	10.2	9.6	11,635	
ケーヨー	14.8	15.2	12,205	
上新電機	7.9	7.8	15,974	
日本瓦斯	11.3	34.9	49,453	
ロイヤルホールディングス	12.4	12.7	23,101	
いなげや	8.7	9.3	12,099	
島忠	13.2	—	—	
チヨダ	9.6	12.1	8,494	
ライフコーポレーション	5.7	6.7	22,478	
リンガーハット	9.3	9.7	20,719	
MrMaxHD	12.5	11.6	6,136	
AOKIホールディングス	17.2	15.6	9,578	
オークワ	11.5	12.5	11,937	
コメリ	11.2	10.7	26,150	
青山商事	18.9	17.1	12,294	
しまむら	8.2	8.3	80,510	
高島屋	52.4	52.7	52,436	
松屋	15.7	15.4	12,905	
エイチ・ツー・オー リテイリング	32.2	33.2	26,228	
近鉄百貨店	3	3.4	8,255	
丸井グループ	65.7	61	127,246	
アクシアル リテイリング	5.8	5.5	17,930	
イオン	274.2	276.1	730,146	
イズミ	14.8	13.1	41,199	
平和堂	13.2	12.5	23,162	
フジ	8.2	8.7	16,704	
ヤオコー	7.9	8.2	54,858	
ゼビオホールディングス	9.8	10.6	9,317	
ケーズホールディングス	68	65.7	75,489	
Olympicグループ	5.8	—	—	
日産東京販売ホールディングス	18.4	21.5	4,837	
Genky DrugStores	3.3	3.2	16,384	
ブックオフグループホールディングス	5.9	5.6	5,432	
ギフト	—	1.6	4,217	
アインホールディングス	8.9	10.6	64,766	
元気寿司	2.6	2.8	6,848	
ヤマダホールディングス	215.4	263.4	104,306	
アークランドサカモト	11.8	11.5	19,078	
ニトリホールディングス	30.8	28.6	515,658	
グルメ軒屋	8.4	10.8	10,605	
吉野家ホールディングス	24.4	25.6	56,960	
松屋フーズホールディングス	3.1	3.6	12,348	
サガミホールディングス	10.1	13.7	13,576	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
関西スーパーマーケット	6.9	5.9	10,820	
王将フードサービス	5	4.7	27,166	
ブレナス	7.5	8.3	16,060	
ミニストップ	6.5	6.6	8,982	
アークス	14.2	13.1	27,077	
パローホールディングス	15.2	15.4	32,586	
ベルク	3.6	3.2	16,832	
大庄	5.4	—	—	
ファーストリテイリング	9.5	9.6	647,040	
サンドラッグ	26.7	27	80,703	
サックスパーホールディングス	9.2	—	—	
ペルーナ	16.6	16.7	11,138	
銀行業（4.7%）				
じもとホールディングス	5.5	—	—	
めぶきフィナンシャルグループ	370.2	369.6	82,790	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10.6	9.7	13,512	
九州フィナンシャルグループ	155.3	141.4	53,732	
ゆうちょ銀行	202	168.2	156,089	
富山第一銀行	18.1	16.8	4,468	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	407.2	406.8	168,008	
西日本フィナンシャルホールディングス	47	47	32,054	
関西みらいフィナンシャルグループ	42.5	—	—	
三十三フィナンシャルグループ	6.7	8.7	11,788	
第四北越フィナンシャルグループ	12.9	11.7	26,910	
ひろぎんホールディングス	106.6	106.2	66,056	
おきなわフィナンシャルグループ	—	7	14,462	
十六フィナンシャルグループ	—	10.1	19,957	
北國フィナンシャルホールディングス	—	7.4	15,643	
新生銀行	52.8	46.7	89,477	
あおぞら銀行	42.4	39.4	97,396	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,879.9	4,609.1	2,771,912	
リソナホールディングス	774.1	822.5	341,831	
三井住友トラスト・ホールディングス	134.5	135.1	480,956	
三井住友フィナンシャルグループ	493.2	497.6	1,842,612	
千葉銀行	237.8	240.4	158,904	
群馬銀行	138.6	133.9	44,320	
武蔵野銀行	11.2	11.2	17,449	
千葉興業銀行	20.2	—	—	
筑波銀行	30.1	—	—	
七十七銀行	24.2	22.9	26,472	
青森銀行	5.6	5.6	8,920	
秋田銀行	4.8	4.3	6,149	
山形銀行	8.7	10.6	8,596	
岩手銀行	5	6	9,660	
東邦銀行	63.6	73.1	14,181	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
東北銀行	4	4	3,856	
みちのく銀行	5.5	4.5	3,289	
ふくおかフィナンシャルグループ	60.2	59.8	109,912	
静岡銀行	170.4	173.8	139,040	
十六銀行	9.1	—	—	
スルガ銀行	74.4	63.4	29,861	
八十二銀行	166.6	155.6	55,393	
山梨中央銀行	9.2	10.8	8,510	
大垣共立銀行	14.2	14.2	25,148	
福井銀行	6	8	10,656	
北國銀行	7.3	—	—	
清水銀行	3	4.4	6,670	
富山銀行	1.5	2.4	4,070	
滋賀銀行	14.1	13.5	23,638	
南都銀行	12	11.6	20,764	
百五銀行	66.3	69.9	22,228	
京都銀行	25.4	25.5	123,037	
紀陽銀行	25.6	25.1	34,110	
ほくほくフィナンシャルグループ	47.4	44.6	34,342	
山陰合同銀行	44.2	43.9	24,759	
中国銀行	61	55.9	46,732	
伊予銀行	100.7	91.9	48,155	
百十四銀行	7.9	9.2	12,420	
四国銀行	11.5	13.4	9,433	
阿波銀行	11.6	11.3	22,995	
大分銀行	4.2	5.5	9,240	
宮崎銀行	5	5.4	10,540	
佐賀銀行	4.7	4.5	6,336	
沖縄銀行	6.5	—	—	
琉球銀行	17.1	18.2	12,958	
セブン銀行	240.4	210.5	47,994	
みずほフィナンシャルグループ	969.1	919.4	1,288,998	
山口フィナンシャルグループ	89.2	83.1	51,605	
名古屋銀行	5.5	5.8	12,719	
北洋銀行	110.4	109.8	25,363	
愛知銀行	2.5	2.9	10,164	
中京銀行	3	4.7	5,569	
大光銀行	2.5	—	—	
愛媛銀行	10.3	13.1	9,432	
京葉銀行	31.9	33.5	14,137	
栃木銀行	40.1	46	8,004	
北日本銀行	2.7	—	—	
東和銀行	14.2	17.4	8,352	
トモニホールディングス	58.5	60.3	17,547	
フィデアホールディングス	75	8.5	10,174	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
池田泉州ホールディングス証券・商品先物取引業（0.7%）	88.8	94.2	14,035	
F P G	22	26.4	14,546	
ジャパンインベストメントアドバイザー	—	6.7	7,658	
S B I ホールディングス	81.8	88.2	257,896	
ジャフコ グループ	11.2	9.2	65,504	
大和証券グループ本社	572.1	538.1	339,487	
野村ホールディングス	1,254.4	1,098.6	524,471	
岡三証券グループ	62.6	56.7	20,922	
丸三証券	22.1	24.3	12,125	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82.5	79.2	29,462	
水戸証券	26.5	24.7	6,644	
いちよし証券	16.3	16.3	10,089	
松井証券	41.9	35.3	27,569	
マネックスグループ	56.3	58.6	54,556	
極東証券	10.9	9.7	7,100	
岩井コスモホールディングス	7	8.1	10,465	
アイザワ証券グループ	14.5	12.5	12,325	
スパークス・グループ	35.8	38.7	12,074	
保険業（1.9%）				
かんぽ生命保険	25.5	72.5	127,455	
S O M P Oホールディングス	134.1	126.8	592,663	
アニコム ホールディングス	24.5	22.2	17,249	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	186.4	161	533,876	
第一生命ホールディングス	403.2	353.9	809,369	
東京海上ホールディングス	252.2	236.7	1,351,083	
T & Dホールディングス	213.2	186.2	249,880	
アドバンスクリエイト	1.8	4	3,924	
その他金融業（1.1%）				
全国保証	20.4	17.3	85,808	
ジェイリース	—	2.8	5,754	
イントラスト	—	5.1	3,697	
日本モーゲージサービス	3.5	4.1	4,255	
C A S A	3	—	—	
アルヒ	11.8	12.2	12,212	
プレミアグループ	4	4.2	14,700	
クレディセゾン	50.1	45.8	51,479	
芙蓉総合リース	7.4	7.4	53,132	
みずほリース	11.2	11.1	32,900	
東京センチュリー	14.3	13.7	74,254	
日本証券金融	34.7	29.4	23,931	
アイフル	110.9	121.5	42,768	
リコーリース	6	6.8	24,582	
イオンフィナンシャルサービス	44.2	38.5	47,239	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
アコム	143.6	141.9	47,820	
ジャックス	8.5	8.2	22,574	
オリエントコーポレーション	203.5	196.9	24,415	
日立キャピタル	17.4	—	—	
オリックス	441.2	436.7	980,391	
三菱H Cキャピタル	175.5	261	139,374	
日本取引所グループ	204.6	181.9	447,292	
イー・ギャランティ	8.8	11.2	27,518	
NECキャピタルソリューション	3.3	3.4	6,507	
不動産業（1.9%）				
いちご	89	83.3	23,657	
日本駐車場開発	99.2	93.1	12,661	
スター・マイカ・ホールディングス	4.8	5.2	6,442	
S R Eホールディングス	—	1.9	17,195	
ヒューリック	152	170.8	183,780	
三栄建築設計	3.8	3.9	6,321	
野村不動産ホールディングス	43.2	38.1	93,916	
三重交通グループホールディングス	18.8	18.4	8,390	
サムティ	10.3	10.1	23,088	
ディア・ライフ	14.3	12.8	6,732	
日本商業開発	6.1	7	11,837	
プレサンスコーポレーション	11.3	10.8	18,511	
日本管理センター	6	5.6	5,723	
フージャースホールディングス	17.3	13.3	8,379	
オープンハウス	22.6	22.8	146,832	
東急不動産ホールディングス	194.4	210.2	123,177	
飯田グループホールディングス	59	60.2	141,349	
ムゲンエステート	10.2	—	—	
ビーロッド	5.7	—	—	
ハウスドゥ	4.7	—	—	
シーアールイー	—	3.1	5,186	
ケイアイスター不動産	—	3.4	29,002	
グッドコムアセット	—	4.4	5,319	
ジェイ・エス・ビー	2.1	2.1	5,741	
パーク24	39	38.9	62,629	
バラカ	3.1	4.4	6,626	
宮越ホールディングス	5.2	4.3	5,172	
三井不動産	346.5	327.6	765,273	
三菱地所	500	471.9	738,523	
平和不動産	13.1	13	44,200	
東京建物	71.1	71	114,168	
ダイビル	18.8	18.9	27,669	
京阪神ビルディング	11.1	12.9	17,763	
住友不動産	160.2	150.8	533,681	
テオオーシー	16.9	16.2	9,007	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
東京楽天地	1.7	2.1	8,358	
スターツコーポレーション	8.9	10.4	25,261	
フジ住宅	11.8	11.6	7,702	
空港施設	11.4	13.2	6,930	
ゴールドクレスト	6.9	6.9	10,294	
エスリード	4	—	—	
日神グループホールディングス	14.5	15.4	7,161	
日本エスコン	13.5	16.1	12,075	
タカラレーベン	36.4	37.4	9,948	
A V A N T I A	7	7.8	6,458	
イオンモール	36.1	35.8	57,530	
ファースト住建	4.8	—	—	
カチタス	18	18.2	76,258	
トーセイ	11.6	11.5	11,074	
サンフロンティア不動産	12.4	11.7	11,208	
F Jネクストホールディングス	7.6	8.8	8,562	
ランドビジネス	11.6	—	—	
日本空港ビルデング	22.8	27.5	137,500	
サービス業（6.4%）				
日本工営	4.9	4.3	13,631	
L I F U L L	28.5	27.1	6,991	
ミクシィ	13.4	16	32,336	
ジェイエイシーリクルートメント	5.8	6.1	12,126	
日本M&Aセンターホールディングス	53	114.5	381,857	
メンバーズ	2.8	2.6	6,065	
UTグループ	11	10.1	40,905	
アイティメディア	3.3	3.9	7,823	
タケエイ	8.6	—	—	
E・Jホールディングス	—	4.8	5,659	
夢真ビーネックスグループ	10.5	18.8	31,320	
コシダカホールディングス	19.8	19.2	11,481	
パソナグループ	8	7.5	26,587	
リンクアンドモチベーション	16.8	16.6	11,736	
G C A	12.1	—	—	
エス・エム・エス	22	23.9	101,216	
パーソルホールディングス	69.6	69.7	228,616	
リニカル	5.9	6.8	5,786	
クックパッド	30	29.6	7,577	
学情	4.1	—	—	
スタジオアリス	4.6	4	8,088	
シミックホールディングス	5.1	5.4	8,348	
総合警備保障	27.3	27.6	133,584	
カカクコム	51.5	51.7	164,147	
アイロムグループ	3.3	3.2	5,468	
ルネサンス	6.2	6.7	7,564	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ディップ	9.7	12.3	48,954	
デジタルホールディングス	5.8	5.4	7,506	
新日本科学	10.2	9.2	14,858	
ツクイホールディングス	19.6	—	—	
ベネフィット・ワン	25.4	25.3	134,596	
エムスリー	152.4	123	752,637	
アウトソーシング	40.3	40.4	60,761	
ウェルネット	11.7	15.2	6,824	
ワールドホールディングス	3	3.2	8,092	
ディー・エヌ・エー	30.1	27	45,360	
博報堂DYホールディングス	95.4	96.8	163,882	
ぐるなび	15.2	14.7	6,894	
タカミヤ	12.5	14.9	6,407	
ジャパンベストレスキューシステム	7.1	5.7	5,443	
ファンコミュニケーションズ	22.8	23.3	9,413	
ライク	3.2	—	—	
エスプール	18	19.8	25,245	
W D Bホールディングス	3.6	3.5	10,937	
手間いらず	—	1.1	5,676	
アドウェイズ	—	11.5	8,774	
バリュウコマース	4.9	5.5	24,860	
インフォマート	71.1	77.1	79,104	
J Pホールディングス	28.8	26.3	6,443	
E P Sホールディングス	10.8	—	—	
プレステージ・インターナショナル	26.8	26.8	18,492	
アミューズ	4.5	4.7	8,906	
ドリームインキュベータ	4	—	—	
クイック	5.4	6.1	8,558	
ケネディクス	58	—	—	
電通グループ	77.9	71.9	259,559	
びあ	1	2.8	10,556	
イオンファンタジー	3.4	3.7	6,430	
シーティーエス	9.3	9.8	7,634	
ネクシィーズグループ	4.8	—	—	
H. U. グループホールディングス	19.6	18.6	53,233	
アルプス技研	6.4	6.8	12,716	
日本空調サービス	10	10	7,790	
オリエンタルランド	73.5	82.3	1,468,232	
ダスキン	16.6	16.5	43,180	
明光ネットワークジャパン	12.4	12.3	6,654	
ファルコホールディングス	5.1	4.5	7,618	
ラウンドワン	20.4	19.8	25,918	
リゾートトラスト	32.3	32.5	60,450	
ビー・エム・エル	8.7	9	31,770	
りらいあコミュニケーションズ	12.6	11.5	11,603	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
リソー教育	37.9	33.8	13,689	
ユー・エス・エス	76.8	78.2	130,281	
東京個別指導学院	—	8.5	5,304	
サイバーエージェント	42.8	172	359,996	
楽天グループ	323.1	358.3	415,986	
クリーク・アンド・リバー社	5	4.2	8,395	
モーニングスター	—	16.6	10,026	
テー・オー・ダブリュー	17.7	—	—	
山田コンサルティンググループ	5.6	5	5,565	
セントラルスポーツ	3.4	3.9	9,137	
フルキャストホールディングス	7.1	6.1	16,152	
エン・ジャパン	12.3	11.3	40,002	
テクノプロ・ホールディングス	13.9	41.9	130,728	
アイ・アールジャパンホールディングス	2.8	3.3	23,397	
KeepPer 技研	6.2	4.6	11,840	
Gunosy	5.8	—	—	
イー・ガーディアン	3.5	3.3	11,500	
ジャパンマテリアル	21.5	21.5	33,368	
ベクトル	10.3	10.5	13,114	
チャーム・ケア・コーポレーション	6.9	6	8,892	
キャリアリンク	—	3.4	4,297	
IBJ	7.6	7.4	7,548	
アサンテ	4.7	5.2	8,782	
N・フィールド	7.2	—	—	
バリューHR	4.2	4	10,024	
M&Aキャピタルパートナーズ	5.6	5.7	31,350	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.8	4	6,852	
ERIホールディングス	—	2.6	3,603	
シグマクス・ホールディングス	5.5	4.5	12,604	
ウィルグループ	6.3	6.1	8,296	
メドピア	3.3	5.4	19,305	
リクルートホールディングス	495.3	537.4	3,708,597	
エラン	4.9	9.7	12,018	
日本郵政	564	910.1	779,045	
ベルシステム24ホールディングス	12	10.3	12,926	
鎌倉新書	6.4	9.2	7,130	
LITALICO	3	—	—	
エアトリ	—	4.7	14,828	
アトラエ	2.4	5.6	13,893	
ストライク	2.7	2.9	16,414	
ソラスト	19.3	17.3	21,348	
セラク	—	2.8	4,922	
インソース	3.4	7	17,171	
ペイカレント・コンサルティング	4.2	4.9	231,770	
Orchestra Holdings	—	1.8	7,146	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
アイモバイル	—	2.8	3,586	
グレイステクノロジー	3.3	11.9	5,021	
ジャパンエレベーターサービズホールディングス	8.1	21.9	46,537	
ウェルビー	—	5.6	7,778	
エル・ティー・エス	—	1.3	3,556	
ミダックホールディングス	—	3.1	15,391	
日総工産	6.7	7.7	6,221	
キュービーネットホールディングス	4	4.4	7,273	
RPAホールディングス	6.6	12.1	4,501	
スプリックス	4.1	—	—	
マネジメントソリューションズ	4.5	3.6	11,736	
プロレド・パートナーズ	1.1	—	—	
カーブスホールディングス	20	19.7	15,247	
ダイレクトマーケティングミックス	—	4	15,360	
ポピンズホールディングス	—	2.1	6,520	
LITALICO	—	5.9	24,721	
アドバンテッジリスクマネジメント	5.9	5.7	3,744	
リロググループ	38.3	38.6	80,789	
東祥	5.7	6	10,044	
TREホールディングス	—	9.8	17,395	
人・夢・技術グループ	—	3.5	6,345	
エイチ・アイ・エス	11.1	15.6	30,279	
ラックランド	—	3.7	10,759	
共立メンテナンス	11.7	12.5	49,937	
イチネンホールディングス	8.8	8.2	10,660	
建設技術研究所	5.4	4.6	10,874	
スペース	6	—	—	
燦ホールディングス	4.5	4.4	6,098	
東京テアトル	4.4	6.1	7,374	
ナガワ	2.3	2.2	25,124	
よみうりランド	1	—	—	
東京競馬	4.4	5.3	21,147	
カナモト	12.5	12.2	26,278	
東京ドーム	28.8	—	—	
西尾レントオール	6.3	6.5	16,373	
トランス・コスモス	6.9	9	28,350	
乃村工藝社	30.2	30.1	30,190	
日本管財	6.3	7.2	19,699	
トーカイ	6.5	6.1	11,888	
セコム	73.3	68.7	526,516	
セントラル警備保障	3.4	3.9	9,387	
丹青社	15.8	15.5	12,555	
メイテック	8.5	8.6	57,276	
応用地質	8.3	7.6	14,918	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)			期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
船井総研ホールディングス	14.7	14.4	36,849			
オオバ	8.2	8.1	6,156			
ベネッセホールディングス	23.7	23.8	52,336			
イオンディライト	8.1	8.5	30,132			
ナック	6	—	—			
ダイセキ	11.8	12.8	66,048			
合計	千株	千株	千円			
	株数・金額	75,624.8	78,890.9	192,569,963		
	銘柄数〈比率〉	1,648銘柄	1,659銘柄	〈97.7%〉		

※銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

※〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	期末	
	買建額	売建額
国内	百万円 4,815	百万円 —
T O P I X		

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月30日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円 192,569,963	% 97.6
コール・ローン等、その他	4,789,350	2.4
投資信託財産総額	197,359,314	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	197,359,314,147円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,159,862,470
株 式 (評価額)	192,569,963,990
未 収 配 当 金	1,330,297,687
差 入 委 託 証 拠 金	299,190,000
(B) 負 債	304,994,395
未 払 金	280,946,773
未 払 解 約 金	24,033,101
そ の 他 未 払 費 用	14,521
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	197,054,319,752
元 本	61,173,269,127
次 期 繰 越 損 益 金	135,881,050,625
(D) 受 益 権 総 口 数	61,173,269,127口
1 万 口 当 ち 基 準 価 額 (C / D)	32,212円

※当期における期首元本額62,877,618,349円、期中追加設定元本額10,732,324,295円、期中一部解約元本額12,436,673,517円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2020年12月1日 至2021年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,117,818,618円
受 取 配 当 金	4,119,293,254
受 取 利 息	1,572
そ の 他 収 益 金	711,505
支 払 利 息	△ 2,187,713
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	17,412,905,832
売 買 益	28,936,137,486
売 買 損	△ 11,523,231,654
(C) 先 物 取 引 等 損 益	204,008,900
取 引 益	744,403,500
取 引 損	△ 540,394,600
(D) そ の 他 費 用 等	△ 299,666
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	21,734,433,684
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	117,608,389,911
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 27,114,163,119
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	23,652,390,149
(I) 合 計 (E + F + G + H)	135,881,050,625
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	135,881,050,625

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

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

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,444,432,886円	SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	108,824,691円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	893,111,379円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,852,669,865円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,314,610,252円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,648,623,694円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,302,572,824円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,291,332,987円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	123,293,850円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	41,040,556円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2020（4資産タイプ）	4,679,600円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	166,358,728円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド（4資産タイプ）	20,378,358円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	748,263,991円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2030（4資産タイプ）	62,968,056円	SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	46,344,355円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2035（4資産タイプ）	145,617,764円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	259,277,705円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2040（4資産タイプ）	123,379,159円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	856,981,897円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2045（4資産タイプ）	223,865,395円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	603,670,244円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,383,108,545円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,898,722,676円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	18,142,394,620円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	374,931円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	277,082,196円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	42,261,700円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	326,588,940円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	47,434,130円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	215,307,143円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	34,163,089円
イオン・バランス戦略ファンド	14,508,106円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,669,461円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2050	29,487,863円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	115,063,306円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	154,290,540円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	248,882,682円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	142,287,008円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	61,933,489円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	489,286,600円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	39,574,438円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	261,074,601円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,375,595円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	295,921,518円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	45,508,490円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	33,623,909円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	613,464,436円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	440,586,720円	SMAM・国内株式インデックスファンド・VA（適格機関投資家専用）	180,359,966円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	14,302,327円	SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定>	237,022,466円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	71,078,321円	SMAM・グローバルバランスファンド（債券重視型）VA<適格機関投資家限定>	110,132,461円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	69,299,615円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	259,324,316円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2060	4,018,342円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	64,476,018円
日興FWS・日本株インデックス	300,009,523円	SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	37,709,634円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	1,878,586円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	55,155,389円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,839,797,359円	SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	59,877,017円
バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定>	12,523,734円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	197,029,085円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

外国株式インデックス・マザーファンド

第19期（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年5月19日）
運用方針	<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。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	投資信託 証券 組入比率	純資産額
	円	%	(配当込み、 円ベース)	%				
15期（2017年11月30日）	33,807	22.7	350.45	23.0	95.2	2.5	2.3	196,182
16期（2018年11月30日）	34,678	2.6	360.38	2.8	93.7	3.9	2.3	174,245
17期（2019年12月2日）	38,813	11.9	404.43	12.2	95.2	2.1	2.7	232,418
18期（2020年11月30日）	42,581	9.7	444.41	9.9	96.8	0.9	2.3	254,097
19期（2021年11月30日）	58,337	37.0	609.64	37.2	95.5	2.2	2.4	353,818

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

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

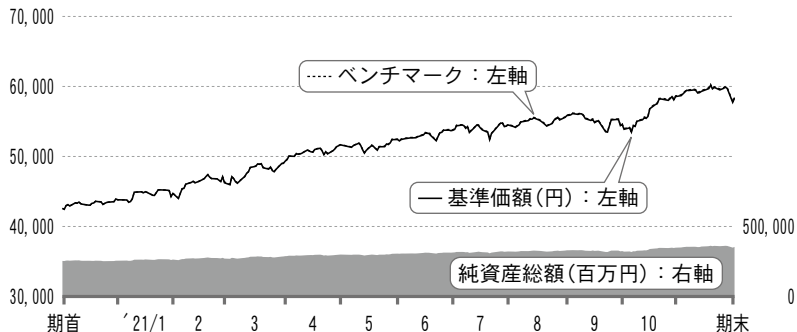
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	42,581円
期末	58,337円
騰落率	+37.0%

※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、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）です。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

上昇要因

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

▶ 投資環境について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

株式市場

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

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

5月は、物価指数が予想以上に上昇して一進一退となりました。

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

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

期間を通じてみると、世界の株式市場は、大きく上昇しました。

為替市場

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

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

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

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

期間を通じてみると、為替市場では、米ドル、ユーロとも対円で上昇しました。

▶ ポートフォリオについて（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

株式組入比率

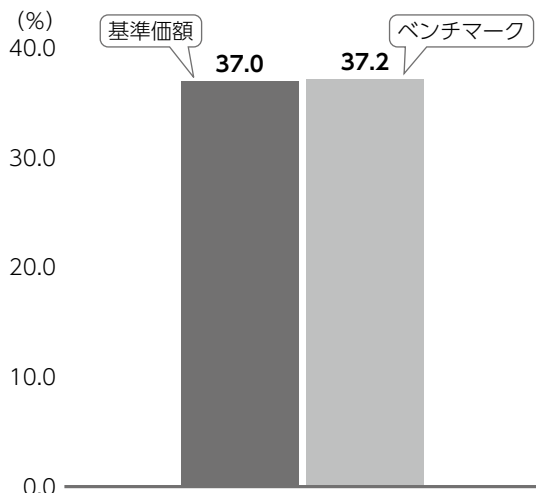
MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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

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

▶ベンチマークとの差異について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

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

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

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

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

■ 1万口当たりの費用明細（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

期中の平均基準価額は51,446円です。

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

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 当期中の売買及び取引状況 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

(1) 株 式

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

外国株式インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ベルギー	96.33	528	178.72	809
	ルクセンブルグ	191.85	222	356.97	235
	フランス	(776.95 319.6)	(△ 5,374 493)	1,466.99	4,578
	ドイツ	(1,064.12 610.92)	(5,909 61)	1,164.95	4,804
	ポルトガル	299.29	323	191.1	217
	スペイン	(1,538.61 465.43)	(△ 1,659 46)	2,243.64	1,250
	イタリア	(3,933.92 -)	(△ 1,309 1)	3,789.01	1,075
	フィンランド	241.52	730	252.87	359
	オーストリア	126.57	491	135.73	463

※金額は受渡し代金。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 新株予約権証券

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

※金額は受渡し代金。

外国株式インデックス・マザーファンド

(3) 投資信託証券

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

※金額は受渡し代金。

※()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(4) 先物取引の種類別取引状況

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

※金額は受渡し代金。

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

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	43,010,068千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	294,102,700千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.14

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2021年11月30日現在)

(1) 外国株式

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		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	
CUMMINS INC	80	82.07	1,783	202,867	資本財
ACTIVISION BLIZZARD INC	412.25	400.92	2,417	275,090	メディア・娯楽
DELTA AIR LINES INC	82.99	82.99	300	34,216	運輸
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	69.25	69.25	662	75,334	運輸
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	95.42	95.42	1,886	214,665	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COTERRA ENERGY INC	196.32	402.61	839	95,457	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	26.81	26.81	1,566	178,197	資本財
MASIMO CORP	29.41	29.41	847	96,461	ヘルスケア機器・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	38.33	36.41	2,345	266,830	小売
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	396.55	378.73	1,745	198,550	食品・生活必需品小売り
SEAGEN INC	66.54	77.9	1,287	146,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COCA-COLA CO/THE	2,186.12	2,206.53	12,043	1,370,159	食品・飲料・タバコ
EXPEDITORS INTL WASH INC	86.89	86.89	1,101	125,308	運輸
BURLINGTON STORES INC	33.91	33.91	994	113,180	小売
FRANKLIN RESOURCES INC	142.98	142.98	482	54,900	各種金融
CSX CORP	415.38	1,218.27	4,339	493,702	運輸
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	49.95	49.95	1,458	165,892	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDIA GROUP INC	68.94	80.61	1,342	152,697	消費者サービス
AMAZON.COM INC	226.03	242.97	86,535	9,845,139	小売
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	323.36	340.18	3,766	428,472	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	2,269.07	2,278.12	14,030	1,596,300	エネルギー
EVEREST RE GROUP LTD	20.65	20.65	545	62,109	保険
EOG RESOURCES INC	308.3	308.3	2,725	310,030	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	83.21	83.21	950	108,167	ソフトウェア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	79.93	79.93	960	109,332	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	171.3	168.73	2,588	294,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FORD MOTOR CO	2,080.63	2,091.41	4,113	468,027	自動車・自動車部品
HORMEL FOODS CORP	149.39	149.39	634	72,216	食品・飲料・タバコ
LIBERTY GLOBAL PLC-A	84.32	84.32	233	26,515	電気通信サービス
KRAFT HEINZ CO/THE	380.96	384.38	1,336	152,096	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	91.54	102.41	1,774	201,938	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	175.57	175.57	1,497	170,323	公益事業
PAYPAL HOLDINGS INC	597.93	601.25	11,257	1,280,800	ソフトウェア・サービス
MSCI INC	43.83	43.83	2,829	321,876	各種金融
FORTINET INC	73.6	73.6	2,526	287,461	ソフトウェア・サービス
ALLY FINANCIAL INC	201.39	201.39	960	109,313	各種金融
ANTHEM INC	136.42	133.09	5,539	630,225	ヘルスケア機器・サービス
NEXTERA ENERGY INC	1,051.98	1,059.66	9,394	1,068,862	公益事業
PALO ALTO NETWORKS INC	52.21	53.93	2,972	338,182	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC	290.19	333.35	3,780	430,072	電気通信サービス
ELECTRONIC ARTS INC	153.52	153.52	1,917	218,115	メディア・娯楽
FREEMPORT-MCMORAN INC	754.31	808.28	3,069	349,256	素材
SYNCHRONY FINANCIAL	278.25	321.12	1,513	172,147	各種金融
MARATHON PETROLEUM CORP	339.33	339.33	2,096	238,505	エネルギー
KEURIG DR PEPPER INC	183.39	382.44	1,345	153,025	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	707.43	746.23	4,283	487,317	銀行
AUTOLIV INC	40.01	40.01	383	43,666	自動車・自動車部品
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	125.9	-	-	-	素材
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	638.81	638.81	933	106,181	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	29.09	29.09	672	76,474	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OLD DOMINION FREIGHT LINE	49.26	55.39	1,978	225,110	運輸
FASTENAL CO	298.92	298.92	1,821	207,245	資本財
FISERV INC	301.44	315.64	3,076	350,018	ソフトウェア・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	4,736.99	589.47	5,800	659,909	資本財
ALIGN TECHNOLOGY INC	38.54	41.54	2,635	299,850	ヘルスケア機器・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	25.22	25.22	1,128	128,380	ソフトウェア・サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株数	金額	株数	金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
KEYERA CORP	113.74	—	113.74	327	29,228	エネルギー	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	—	63.63	433	38,712	ソフトウェア・サービス	
LOBLAW COMPANIES LTD	86.83	—	86.83	841	75,070	食品・生活必需品小売り	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC	—	—	30.84	378	33,812	ソフトウェア・サービス	
NORTHLAND POWER INC	—	—	108.7	422	37,684	公益事業	
ONEX CORPORATION	42.17	—	42.17	403	35,988	各種金融	
OPEN TEXT CORP	136.65	—	136.65	847	75,672	ソフトウェア・サービス	
PARKLAND CORP	76.66	—	76.66	261	23,381	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	274.11	—	321.72	1,240	110,702	エネルギー	
POWER CORP OF CANADA	332.78	—	317.68	1,328	118,613	保険	
RESTAURANT BRANDS INTERN	145.1	—	145.1	1,058	94,495	消費者サービス	
SSR MINING INC	115.52	—	—	—	—	素材	
SAPUTO INC	134.25	—	134.25	389	34,727	食品・飲料・タバコ	
SHOPIFY INC - CLASS A	58.05	—	60.82	12,164	1,085,758	ソフトウェア・サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	324.94	—	305.5	2,097	187,255	保険	
TMX GROUP LTD	31.42	—	31.42	404	36,069	各種金融	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	—	38.43	426	38,055	資本財	
小計	株数	金額	株数	金額	金額	金額	
	82銘柄	20,792.08	88銘柄	21,673.53	134,073	11,967,436	<3.4%>
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル			
AURIZON HOLDINGS LTD	944.4	—	944.4	322	26,178	運輸	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	57.83	—	57.83	188	15,339	各種金融	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	385.84	—	658.44	636	51,704	素材	
BHP GROUP LTD	1,595.2	—	1,575.18	6,075	493,874	素材	
REA GROUP LTD	28.33	—	28.33	456	37,077	メディア・娯楽	
AUSNET SERVICES	852.2	—	1,377.72	347	28,222	公益事業	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	—	37.94	493	40,146	消費者サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,287.24	—	1,287.24	432	35,158	保険	
CIMIC GROUP LTD	40.62	—	—	—	—	資本財	
SOUTH32 LTD	3,006.71	—	2,763.48	986	80,197	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	503.54	—	503.54	1,069	86,941	エネルギー	
WISETECH GLOBAL LTD	79.09	—	79.09	409	33,309	ソフトウェア・サービス	
XERO LTD	—	—	74.59	1,053	85,621	ソフトウェア・サービス	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	52.94	—	140.25	436	35,468	エネルギー	
AFTERPAY LTD	115.68	—	114.91	1,270	103,265	ソフトウェア・サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	921.05	—	884.48	1,556	126,542	素材	
COLES GROUP LTD	664.43	—	735.52	1,326	107,802	食品・生活必需品小売り	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	—	656.07	449	36,532	食品・生活必需品小売り	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,666.95	—	1,731.85	4,710	382,927	銀行	
WESTPAC BANKING CORP	1,975.23	—	2,017.31	4,220	343,061	銀行	
SANTOS LTD	845.86	—	1,003.76	641	52,139	エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,480.02	—	1,480.02	3,939	320,267	銀行	
RIO TINTO LTD	193.36	—	193.36	1,844	149,936	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	1,094.48	—	880.6	433	35,219	公益事業	
EVOLUTION MINING LTD	844.2	—	844.2	347	28,273	素材	
OIL SEARCH LTD	1,056.18	—	1,056.18	412	33,570	エネルギー	
SEEK LTD	181.86	—	172.66	592	48,141	メディア・娯楽	
AGL ENERGY LTD	324.92	—	324.92	173	14,077	公益事業	
TREASURY WINE ESTATES LTD	364.64	—	364.64	434	35,332	食品・飲料・タバコ	
NEWCREST MINING LTD	421.31	—	421.31	1,018	82,812	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	949.46	—	960.41	9,006	732,156	銀行	
AMPOL LTD	133.86	—	109.27	316	25,697	エネルギー	
ORICA LTD	179.81	—	179.81	258	21,018	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	855.23	—	808.63	938	76,250	保険	
WOOLWORTHS GROUP LTD	680.13	—	656.07	2,630	213,861	食品・生活必需品小売り	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	343.39	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ	

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	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		
EPIROC AB-A	—	342.3	7,468	93,586	資本財	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	49.51	82.23	2,811	35,227	資本財	
KINNEVIK AB - B	—	124.65	4,095	51,315	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—	98.51	2,709	33,944	各種金融	
SKF AB-B SHARES	206.07	206.07	4,333	54,300	資本財	
ELECTROLUX AB-B	150.98	115.55	2,353	29,492	耐久消費財・アパレル	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	428.37	401.48	6,528	81,806	小売	
NORDEA BANK ABP	1,679.42	1,679.42	18,010	225,666	銀行	
SWEDISH MATCH AB	—	846.4	5,669	71,034	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	255.37	255.37	3,349	41,965	電気通信サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	883.17	883.17	11,613	145,519	銀行	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	776.68	776.68	7,482	93,756	銀行	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	343.7	343.7	5,179	64,899	素材	
SKANSKA AB-B SHS	208.21	171.83	3,613	45,278	資本財	
SANDVIK AB	610.7	610.7	14,009	175,538	資本財	
INVESTOR AB-B SHS	—	1,012.75	21,455	268,832	各種金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	344.34	373.42	20,821	260,898	資本財	
SECURITAS AB-B SHS	161.23	161.23	2,143	26,858	商業・専門サービス	
TELIA CO AB	1,280.45	1,434.04	5,072	63,563	電気通信サービス	
ALFA LAVAL AB	139.39	186.97	6,760	84,713	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	197.87	197.87	9,404	117,841	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	521.19	521.19	13,498	169,140	資本財	
BOLIDEN AB	—	130.86	4,009	50,239	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	185.93	185.93	2,444	30,623	資本財	
HEXAGON AB-B SHS	—	1,031.1	13,765	172,477	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LUNDIN ENERGY AB	85.81	85.81	2,906	36,417	エネルギー	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	53.23	3,645	45,674	不動産	
SWEDISH MATCH AB	84.64	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
EPIROC AB-B	251.32	—	—	—	資本財	
EQT AB	156.14	154.43	8,206	102,826	各種金融	
EVOLUTION AB	66.29	90.21	9,051	113,417	消費者サービス	
KINNEVIK AB-B SHS	136.78	—	—	—	各種金融	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	184.41	—	—	—	資本財	
INVESTOR AB-B SHS	236.14	—	—	—	各種金融	
VOLVO AB-A SHS	—	132.83	2,683	33,620	資本財	
HEXAGON AB-B SHS	147.3	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
EPIROC AB-A	393.07	—	—	—	資本財	
BOLIDEN AB	130.86	—	—	—	素材	
EMBRACER GROUP AB	—	300.12	2,853	35,754	メディア・娯楽	
EPIROC AB-B	—	198.36	3,580	44,862	資本財	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	—	737.64	9,375	117,473	資本財	
SINCH AB	—	276.9	3,421	42,866	ソフトウェア・サービス	
小 計	株数 銘柄数	金額 <比率>	13,696.15 36銘柄	17,558.05 41銘柄	300,025 — <1.1%>	3,759,319
(ユーロ・・・アイルランド)				千ユーロ		
KINGSPAN GROUP PLC	80.21	80.84	808	103,785	資本財	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	129.21	129.21	592	76,106	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	82.37	88.69	1,082	138,998	消費者サービス	
KERRY GROUP PLC-A	85.06	81.93	887	113,991	食品・飲料・タバコ	
CRRH PLC	410.91	434.26	1,884	242,012	素材	
小 計	株数 銘柄数	金額 <比率>	787.76 5銘柄	814.93 5銘柄	5,255 — <0.2%>	674,895
(ユーロ・・・オランダ)				千ユーロ		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	480.02	477.6	1,516	194,687	ヘルスケア機器・サービス	
AIRBUS SE	314.64	320.94	3,199	410,841	資本財	
HEINEKEN HOLDING NV	61.68	61.68	476	61,224	食品・飲料・タバコ	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等
		株数	評価額		
		株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
NN GROUP NV	159.22	140.69	617	79,291	保険
QIAGEN N.V.	125.43	125.43	617	79,292	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABN AMRO BANK NV-CVA	189.16	287.87	364	46,842	銀行
STELLANTIS NV	—	1,055.16	1,642	210,935	自動車・自動車部品
VOPAK	31.3	31.3	103	13,335	エネルギー
FERRARI NV	64.52	69.49	1,638	210,409	自動車・自動車部品
ADYEN NV	9.42	10.69	2,630	337,753	ソフトウェア・サービス
PROSUS NV	264.14	510.18	3,605	463,040	小売
CNH INDUSTRIAL NV	547.75	547.75	818	105,118	資本財
ASM INTERNATIONAL NV	—	24.55	973	124,963	半導体・半導体製造装置
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	—	384.96	962	123,631	メディア・娯楽
HEINEKEN NV	131.43	131.43	1,228	157,697	食品・飲料・タバコ
AEGON NV	916.09	916.09	360	46,336	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	594.52	556.57	1,683	216,229	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL N.V.	103.99	98.86	933	119,913	素材
KONINKLIJKE DSM NV	89.94	94.22	1,807	232,054	素材
WOLTERS KLUWER	145.78	145.78	1,462	187,757	商業・専門サービス
ING GROEP NV	2,052.37	2,052.37	2,495	320,417	銀行
KONINKLIJKE KPN NV	1,736.03	1,736.03	454	58,383	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	228.41	225.44	15,889	2,040,307	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	72.79	62.41	350	44,958	商業・専門サービス
JDE PEET'S NV	—	21.66	54	6,967	食品・飲料・タバコ
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	280.21	280.21	366	47,082	食品・飲料・タバコ
ARGENX SE	23.3	26.44	663	85,184	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	642.8	—	—	—	自動車・自動車部品
JUST EAT TAKEAWAY	63.55	93.07	541	69,495	小売
EXOR NV	62.04	62.04	489	62,840	各種金融
STMICROELECTRONICS NV	332.61	378.04	1,626	208,861	半導体・半導体製造装置
ALTICE EUROPE NV	376.25	—	—	—	電気通信サービス
小計	株数 銘柄数	10,099.39 28銘柄	10,928.95 30銘柄	49,574 —	6,365,856 <1.8%>
(ユーロ・・・ベルギー)			千ユーロ		
SOFINA	8.04	8.04	327	41,998	各種金融
UCB SA	66.23	66.23	642	82,528	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KBC GROUP NV	144.07	130.92	950	122,017	銀行
COLRUYT SA	28.7	21.64	89	11,490	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	59.14	59.14	572	73,526	各種金融
SOLVAY SA	37.58	37.58	372	47,880	素材
UMICORE	105.6	102.88	443	56,899	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	398.98	409.43	2,081	267,290	食品・飲料・タバコ
AGEAS	87.65	112.47	520	66,882	保険
PROXIMUS	96.97	46.17	74	9,503	電気通信サービス
GALAPAGOS NV	23.18	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELIA GROUP SA/NV	19.57	20.63	225	28,901	公益事業
TELENET GROUP HOLDINGS NV	21.81	—	—	—	メディア・娯楽
小計	株数 銘柄数	1,097.52 13銘柄	1,015.13 11銘柄	6,299 —	808,919 <0.2%>
(ユーロ・・・ルクセンブルグ)			千ユーロ		
ARCELORMITTAL	366.89	366.89	896	115,142	素材
SES	278.6	—	—	—	メディア・娯楽
TENARIS SA	259.63	259.63	231	29,745	エネルギー
EUROFINS SCIENTIFIC	70.1	70.1	791	101,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AROUNDTOWN SA	521.14	525.6	290	37,255	不動産
INPOST SA	—	109.02	112	14,436	運輸
小計	株数 銘柄数	1,496.36 5銘柄	1,331.24 5銘柄	2,322 —	298,278 <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		業種等
	株数	株数	評価金額	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ・・・フランス)			千ユーロ		
BUREAU VERITAS SA	178.17	178.17	504	64,769	商業・専門サービス
ORANGE	1,061.32	1,061.32	1,019	130,887	電気通信サービス
JCDECAUX SA	28.28	—	—	—	メディア・娯楽
GETLINK SE	223.11	223.11	287	36,943	運輸
SUEZ	189.86	189.86	375	48,199	公益事業
DASSAULT AVIATION SA	1.72	17.2	145	18,652	資本財
FAURECIA	31.27	60.9	226	29,044	自動車・自動車部品
TOTALENERGIES SE	1,334.48	1,354.3	5,579	716,491	エネルギー
TELEPERFORMANCE	29.7	29.7	1,061	136,304	商業・専門サービス
WORLDBLINE SA	127.74	127.74	606	77,865	ソフトウェア・サービス
ESSILORLUXOTTICA	153.58	157.04	2,832	363,745	耐久消費財・アパレル
AMUNDI SA	39.55	39.55	296	38,115	各種金融
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	15.55	15.55	798	102,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICHELIN (CGDE)	87.46	87.46	1,122	144,146	自動車・自動車部品
AIR LIQUIDE SA	256.34	251.83	3,710	476,525	素材
KERING	41.33	39.06	2,670	342,973	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE	294.47	293.3	4,435	569,609	資本財
BOUYGUES SA	110.49	110.49	330	42,436	資本財
BNP PARIBAS	604.36	612.93	3,394	435,875	銀行
PEUGEOT SA	281.39	—	—	—	自動車・自動車部品
THALES SA	54.03	54.03	399	51,257	資本財
DANONE	320.81	343	1,863	239,294	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	358.27	359.9	545	70,107	食品・生活必需品小売り
VIVENDI SE	441.96	384.96	431	55,364	メディア・娯楽
L'OREAL	135.48	136.29	5,476	703,190	家庭用品・パーソナル用品
LEGRAND SA	149.97	133.23	1,276	163,861	資本財
PERNOD RICARD SA	111.12	111.08	2,294	294,689	食品・飲料・タバコ
SOCIETE GENERALE SA	410.25	410.25	1,127	144,791	銀行
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	149.19	148.67	10,365	1,331,004	耐久消費財・アパレル
ACCOR SA	104.51	104.51	278	35,791	消費者サービス
CAPGEMINI SE	80.59	89.61	1,809	232,322	ソフトウェア・サービス
VALEO	140.48	144.44	354	45,571	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	107.36	133.01	770	98,994	メディア・娯楽
SODEXO SA	39	39	293	37,630	消費者サービス
SEB SA	10.25	11.27	150	19,290	耐久消費財・アパレル
AXA SA	1,063.04	1,004.73	2,434	312,673	保険
EDENRED	121.39	121.39	491	63,130	ソフトウェア・サービス
RENAULT SA	88.3	88.3	257	33,046	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	16.76	16.76	2,748	352,952	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	60.86	45.92	171	22,029	ソフトウェア・サービス
DASSAULT SYSTEMES SE	70.23	351.15	1,876	240,922	ソフトウェア・サービス
ALSTOM	96.68	176.65	571	73,426	資本財
CNP ASSURANCES	89.78	89.78	193	24,878	保険
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	255.83	264.13	1,511	194,140	資本財
SANOFI	606.98	615.68	5,270	676,828	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VINCI SA	276.68	293.09	2,466	316,741	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	285.61	361.22	1,020	130,989	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	581.4	581.4	705	90,574	銀行
ENGIE	948.86	948.86	1,223	157,104	公益事業
UBISOFT ENTERTAINMENT	47.45	47.45	213	27,351	メディア・娯楽
EDF	296.44	207.79	256	32,939	公益事業
SAFRAN SA	173.98	182.12	1,850	237,602	資本財
ILIAD SA	10.16	—	—	—	電気通信サービス
ARKEMA	32.5	32.5	377	48,410	素材
SCOR SE	70.99	109.07	291	37,395	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等
		株数	評価額	外貨建金額	
IPSEN	14.98	14.98	129	16,692	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOLLORE	394.33	394.33	187	24,133	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	12.73	12.73	271	34,883	食品・飲料・タバコ
EURAZEO SE	17.92	17.92	131	16,901	各種金融
ORPEA	26.95	26.95	225	28,931	ヘルスケア機器・サービス
WENDEL	10.82	10.82	111	14,380	各種金融
EIFFAGE	49.89	49.89	410	52,737	資本財
ADP	13.46	13.46	140	18,044	運輸
NATIXIS	453.62	—	—	—	各種金融
BIOMERIEUX	25.91	15.7	199	25,674	ヘルスケア機器・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	57.85	57.85	241	31,073	消費者サービス
小計	13,975.82	13,605.38	82,819	10,634,812	
	66銘柄	62銘柄	—	< 3.0% >	
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ		
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	18.56	—	—	—	運輸
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	468.95	468.95	110	14,193	電気通信サービス
BAYER AG-REG	532.63	517.33	2,344	301,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA	59.74	59.74	399	51,243	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	84.4	86.77	517	66,429	素材
EVONIK INDUSTRIES AG	133.12	109.52	292	37,549	素材
VONOVIA SE	280.71	395	1,942	249,399	不動産
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	77.65	77.65	582	74,782	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	25.08	25.64	180	23,211	自動車・自動車部品
KION GROUP AG	31.79	31.79	298	38,331	資本財
ZALANDO SE	79.11	123.67	1,007	129,425	小売
BECHTLE AG	—	43.05	272	34,959	ソフトウェア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	52.69	52.69	173	22,341	電気通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,024.59	1,134.78	1,211	155,596	各種金融
COVESTRO AG	93.46	117.97	597	76,772	素材
MTU AERO ENGINES AG	29.57	29.57	495	63,658	資本財
UNIPER SE	104.56	46.97	181	23,329	公益事業
COMMERZBANK AG	466.44	466.44	290	37,344	銀行
METRO AG	93.68	—	—	—	食品・生活必需品小売り
VOLKSWAGEN AG	19.84	19.6	500	64,279	自動車・自動車部品
SARTORIUS AG-VORZUG	18.04	13.08	758	97,416	ヘルスケア機器・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	98.69	97.76	1,608	206,527	自動車・自動車部品
LEG IMMOBILIEN SE	36.8	36.8	456	58,666	不動産
DEUTSCHE WOHNEN SE	181.44	—	—	—	不動産
NEMETSCHKE SE	30.11	30.11	323	41,583	ソフトウェア・サービス
RATIONAL AG	—	3.5	284	36,476	資本財
SYMRISE AG	65.24	65.24	821	105,472	素材
DELIVERY HERO SE	66.75	80.61	961	123,488	小売
SIEMENS ENERGY AG	198.55	198.55	478	61,419	資本財
TEAMVIEWER AG	95.85	90.59	111	14,366	ソフトウェア・サービス
VONOVIA SE-RTS	—	293.04	90	11,627	不動産
SIEMENS AG-REG	409.59	409.05	5,913	759,317	資本財
E.ON SE	1,166.81	1,269.98	1,395	179,255	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	178.73	178.73	1,533	196,871	自動車・自動車部品
GEA GROUP AG	81.78	81.78	364	46,804	資本財
CONTINENTAL AG	55.78	55.78	520	66,792	自動車・自動車部品
BASF SE	499.52	494.39	2,866	368,083	素材
ALLIANZ SE-REG	225.21	217.83	4,184	537,277	保険
THYSSENKRUPP AG	193.67	—	—	—	素材
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	90.43	90.43	642	82,562	家庭用品・パーソナル用品
RWE AG	347.39	346.73	1,214	155,921	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	165.74	331.48	182	23,415	運輸

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	金額	株数	金額	
	株数	金額	株数	金額	
BRENTAG SE	73.92	73.92	73.92	564	資本財
FRESENIUS SE & CO KGAA	221.74	213.63	213.63	721	ヘルスケア機器・サービス
SAP SE	560.6	550.37	550.37	6,428	ソフトウェア・サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	75.72	73.64	73.64	1,760	保険
BEIERSDORF AG	51.38	51.38	51.38	458	家庭用品・パーソナル用品
MERCK KGAA	65.53	68.32	68.32	1,500	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADIDAS AG	102.34	101.46	101.46	2,580	耐久消費財・アパレル
PUMA SE	59.94	50.52	50.52	537	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,815.43	1,830.3	1,830.3	2,935	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	111.18	111.18	111.18	595	ヘルスケア機器・サービス
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	444.02	466.8	466.8	3,865	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	650.83	715.33	715.33	2,877	半導体・半導体製造装置
HANNOVER RUECK SE	30.58	30.58	30.58	475	保険
DEUTSCHE POST AG-REG	513.45	544.53	544.53	2,917	運輸
DEUTSCHE BOERSE AG	100.31	107.01	107.01	1,521	各種金融
LANXESS AG	44.09	44.09	44.09	225	素材
FUCHS PETROLUB SE-PREF	33.7	33.7	33.7	134	素材
HOCHTIEF AG	19.31	—	—	—	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	22.69	19.24	19.24	341	ヘルスケア機器・サービス
KNORR-BREMSE AG	38.81	38.81	38.81	350	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	141.82	164.26	164.26	1,058	ヘルスケア機器・サービス
SCOUT24 SE	56.1	46.71	46.71	279	メディア・娯楽
HELLOFRESH SE	—	97.9	97.9	925	食品・生活必需品小売り
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	株数 銘柄数	金額 <比率>	
	13,116.18 61銘柄	13,626.27 60銘柄	13,626.27 60銘柄	69,167 —	8,881,824 <2.5%>
(ユーロ・・・ポルトガル)				千ユーロ	
GALP ENERGIA SGPS SA	304.82	296.87	296.87	249	エネルギー
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	1,879.06	1,879.06	1,879.06	1	銀行
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,359.64	1,459.1	1,459.1	709	公益事業
JERONIMO MARTINS	147.29	163.97	163.97	319	食品・生活必需品小売り
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	株数 銘柄数	金額 <比率>	
	3,690.81 4銘柄	3,799 4銘柄	3,799 4銘柄	1,280 —	164,453 <0.0%>
(ユーロ・・・スペイン)				千ユーロ	
BANKINTER SA	364.05	—	—	—	銀行
TELEFONICA SA	2,737	2,742.78	2,742.78	1,086	電気通信サービス
FERROVIAL SA	275.2	246.93	246.93	619	資本財
AENA SME SA	35.56	43.77	43.77	566	運輸
EDP RENOVAVEIS SA	—	147.91	147.91	332	公益事業
CAIXABANK SA	1,819.81	2,181.03	2,181.03	498	銀行
CELLNEX TELECOM SA	163.78	270.81	270.81	1,441	電気通信サービス
ENDESA SA	141.04	141.04	141.04	284	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,528.89	3,528.89	3,528.89	1,694	銀行
IBERDROLA SA	3,189.22	3,127.16	3,127.16	3,100	公益事業
REPSOL SA	791.25	793.58	793.58	786	エネルギー
GRIFOLS SA	151.69	151.69	151.69	253	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANCO SANTANDER SA	8,933.41	9,272.2	9,272.2	2,580	銀行
AMADEUS IT GROUP SA	237.77	245.7	245.7	1,427	ソフトウェア・サービス
NATURGY ENERGY GROUP SA	154.39	154.39	154.39	380	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	157.16	129.31	129.31	278	資本財
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	580.98	583.28	583.28	1,730	小売
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	114.82	114.82	114.82	269	資本財
ENAGAS SA	144.71	144.71	144.71	291	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	236.32	236.32	236.32	437	公益事業
MAPFRE SA	463.67	—	—	—	保険
FERROVIAL SA RTS	275.2	—	—	—	資本財
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	株数 銘柄数	金額 <比率>	
	24,495.92 21銘柄	24,256.32 19銘柄	24,256.32 19銘柄	18,060 —	2,319,148 <0.7%>

外国株式インデックス・マザーファンド

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

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

※<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

外国株式インデックス・マザーファンド

(2) 外国新株予約権証券

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

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

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(3) 外国投資信託証券

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

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首 (前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額		組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,613	—	—	—	—	
WELLTOWER INC	22,737	23,388	1,918	218,296	0.1	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756	28,756	979	111,429	0.0	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,664	8,664	734	83,607	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	85,417	64,936	542	61,687	0.0	
PUBLIC STORAGE	8,249	8,249	2,737	311,475	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	8,289	8,289	586	66,729	0.0	
UDR INC	16,633	16,633	955	108,752	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	14,362	10,364	287	32,732	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	14,002	15,126	2,553	290,468	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	7,483	7,376	1,497	170,392	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,750	31,858	684	77,890	0.0	
WP CAREY INC	8,640	8,640	680	77,409	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	731,049 39銘柄	672,476 36銘柄	60,354	6,866,548 <1.9%>	1.9
(カナダ)			千カナダ・ドル			
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,546	—	—	—	—	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	3,585	—	—	—	—	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,971	3,971	232	20,721	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441	7,441	164	14,691	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	21,543 4銘柄	11,412 2銘柄	396	35,412 <0.0%>	0.0
(オーストラリア)			千オーストラリア・ドル			
SCENTRE GROUP	275,200	275,200	836	68,007	0.0	
LENDLEASE GROUP	36,263	36,263	384	31,246	0.0	
DEXUS/AU	54,256	54,256	588	47,853	0.0	
TRANSURBAN GROUP	145,680	161,485	2,210	179,710	0.1	
SYDNEY AIRPORT	73,899	62,186	512	41,654	0.0	
APA GROUP	68,344	55,644	539	43,876	0.0	
GPT GROUP	97,296	121,221	629	51,142	0.0	
MIRVAC GROUP	200,053	200,053	580	47,160	0.0	
STOCKLAND	127,393	127,393	554	45,047	0.0	
GOODMAN GROUP	86,301	86,301	2,118	172,228	0.0	
VICINITY CENTRES	250,037	241,241	408	33,239	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	1,414,722 11銘柄	1,421,243 11銘柄	9,363	761,167 <0.2%>	0.2
(香港)			千香港・ドル			
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000	197,000	2,092	30,524	0.0	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	125,000	193,500	1,480	21,597	0.0	
LINK REIT	110,100	110,100	7,563	110,356	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	432,100 3銘柄	500,600 3銘柄	11,136	162,478 <0.0%>	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	組入比率
(シンガポール)						千シンガポール・ドル		
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	159,000		170,500		509	42,420	0.0
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	238,488		259,616		555	46,229	0.0
	SUNTEC REIT	102,700		—		—	—	—
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	138,100		208,100		397	33,073	0.0
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	104,900		112,400		234	19,547	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	743,188		750,616		1,697	141,270	0.0
		5銘柄		4銘柄			<0.0%>	
(イギリス)						千イギリス・ポンド		
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861		39,861		299	45,370	0.0
	SEGRO PLC	59,874		68,623		972	147,427	0.0
	BRITISH LAND CO PLC	44,962		44,962		234	35,530	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	144,697		153,446		1,506	228,328	0.1
		3銘柄		3銘柄			<0.1%>	
(ユーロ・・・フランス)						千ユーロ		
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,630		7,024		421	54,117	0.0
	ICADE	2,061		—		—	—	—
	GECINA SA	2,189		2,189		261	33,548	0.0
	KLEPIERRE	9,305		13,600		259	33,277	0.0
	COVIVIO	2,388		2,388		175	22,495	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	24,573		25,201		1,117	143,437	0.0
		5銘柄		4銘柄			<0.0%>	
ユーロ通貨計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	24,573		25,201		1,117	143,437	0.0
		5銘柄		4銘柄			<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,511,872		3,534,994		—	8,338,643	2.4
		70銘柄		63銘柄			<2.4%>	

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

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	期		末	
			買 建 額	売 建 額		
外	S & P	500	EMINI	FUT	百万円	百万円
					5,899	—
国	S P I	200	FUTURE	S	249	—
	F T S E	100	IDX	FUT	323	—
	E U R O	S T O X X	50		1,138	—

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

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月30日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	338,023,942	95.5
投 資 証 券	8,338,643	2.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,605,914	2.1
投 資 信 託 財 産 総 額	353,968,499	100.0

※期末における外貨建資産（352,603,331千円）の投資信託財産総額（353,968,499千円）に対する比率は99.6%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シケル=36.011円、1スイス・フラン=123.25円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローナ=12.53円、1ユーロ=128.41円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月30日現在)

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

※当期における期首元本額59,674,216,686円、期中追加設定元本額13,275,575,985円、期中一部解約元本額12,298,918,149円です。

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

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

■ 損益の状況

(自2020年12月1日 至2021年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,981,491,031円
受 取 配 当 金	4,944,288,559
受 取 利 息	212
そ の 他 収 益 金	37,690,887
支 払 利 息	△ 488,627
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	86,164,449,326
売 買 益	93,253,928,084
売 買 損	△ 7,089,478,758
(C) 先 物 取 引 等 損 益	1,224,205,499
取 引 益	1,380,162,208
取 引 損	△ 155,956,709
(D) そ の 他 費 用 等	△ 130,283,930
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)	92,239,861,926
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	194,422,937,325
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 49,229,658,029
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	55,734,221,048
(I) 合 計 (E + F + G + H)	293,167,362,270
次 期 繰 越 損 益 金(I)	293,167,362,270

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

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

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

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	31,877,680,130円	三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	12,792,410円
三井住友・DC年金バランス30 (債券重点型)	257,237,232円	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	591,445,429円
三井住友・DC年金バランス50 (標準型)	1,092,113,150円	バランスファンドVA (安定運用型) <適格機関投資家限定>	3,447,518円
三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)	759,876,748円	SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	32,980,346円
SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	63,296,820円	SMAM・バランスファンドVA 2 5 <適格機関投資家専用>	704,179,317円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020 (4資産タイプ)	1,131,648円	SMAM・バランスファンドVA 3 7. 5 <適格機関投資家専用>	824,854,056円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025 (4資産タイプ)	5,750,140円	SMAM・バランスファンドVA 5 0 <適格機関投資家専用>	3,604,698,411円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030 (4資産タイプ)	17,334,902円	SMAM・バランスファンドVL 3 0 <適格機関投資家限定>	12,109,077円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035 (4資産タイプ)	47,583,616円	SMAM・バランスファンドVL 5 0 <適格機関投資家限定>	64,600,386円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040 (4資産タイプ)	49,206,031円	SMAM・バランスファンドVA 7 5 <適格機関投資家専用>	508,707,107円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045 (4資産タイプ)	93,432,630円	SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	41,029,721円
外国株式指数ファンド	762,591,588円	SMAM・インデックス・バランスVA 2 5 <適格機関投資家専用>	102,099,408円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	12,154,970,474円	SMAM・インデックス・バランスVA 5 0 <適格機関投資家専用>	495,008,013円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	136,154,453円	SMAM・バランスファンドVA 4 0 <適格機関投資家専用>	350,695,262円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	161,478,755円	SMAM・バランスファンドVA 3 5 <適格機関投資家専用>	829,398,471円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	106,177,098円	SMAM・バランスVA株4 0 T <適格機関投資家限定>	218,848円
イオン・バランス戦略ファンド	26,039,960円	三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS (適格機関投資家専用)	218,605,667円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,113,153円	SMAM・グローバルバランス4 0 VA <適格機関投資家限定>	75,145,593円
三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型)	110,598,046円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 0 A <適格機関投資家専用>	8,737,379円
三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型)	97,319,132円	SMAM・アセットバランスファンドVA 3 5 A <適格機関投資家専用>	7,911,776円
三井住友・資産最適化ファンド (3 バランス型)	330,128,909円	SMAM・アセットバランスファンドVA 5 0 A <適格機関投資家専用>	4,096,558円
三井住友・資産最適化ファンド (4 やや成長型)	170,705,412円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 0 L <適格機関投資家専用>	21,448,701円
三井住友・資産最適化ファンド (5 成長重視型)	195,254,066円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 5 L <適格機関投資家専用>	60,189,060円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	38,559,109円	SMAM・グローバルバランスファンド (標準型) VA <適格機関投資家限定>	139,958,110円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	509,621,059円	SMAM・グローバルバランスファンド (債券重視型) VA <適格機関投資家限定>	63,429,174円
三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型)	4,097,387円	SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	817,767,596円
三井住友DS・年金バランス50 (標準型)	17,354,910円	SMAM・世界バランスファンドVA 2 <適格機関投資家限定>	118,979,244円
三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型)	15,630,593円	SMAM・外国株式インデックスファンドSA <適格機関投資家限定>	1,028,620,924円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,093,613円	SMAM・年金Wリスクコントロールファンド <適格機関投資家限定>	27,233,124円
SMBC・DCインデックスファンド (MSC I コクサイ)	110,450,992円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	37,994,675円
日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジあり)	67,713,873円	SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	41,244,635円
日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジなし)	281,821,366円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII <適格機関投資家限定>	222,731,531円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

第11期（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

信託期間	無期限（設定日：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。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		（ベンチマーク） MSCIエマージング・ マーケット・インデックス		株式組入 比率	株式先物 率 比 （買建-売建）	公社債 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資 産額
	円	%	（配当込み、 円ベース）	%					
7期（2017年11月30日）	14,363	32.8	156.96	36.0	—	100.2	79.8	—	百万円 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
10期（2020年11月30日）	15,253	14.6	170.44	15.0	61.5	30.4	—	8.3	11,054
11期（2021年11月30日）	16,743	9.8	189.30	11.1	56.5	34.1	—	10.1	17,548

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) MSCIエマージング・ マーケット・インデックス (配当込み、 円ベース)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	投 資 信 託 証 券 組 入 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2020年11月30日	円 15,253	% —	170.44	% —	% 61.5	% 30.4	% 8.3
12月末	15,658	2.7	175.17	2.8	72.9	23.6	10.1
2021年1月末	16,880	10.7	188.57	10.6	67.0	24.0	8.9
2月末	17,409	14.1	196.75	15.4	63.8	27.8	8.4
3月末	17,456	14.4	195.93	15.0	67.5	23.0	9.5
4月末	17,797	16.7	199.61	17.1	65.7	24.6	9.7
5月末	17,907	17.4	200.96	17.9	70.7	18.4	11.0
6月末	18,279	19.8	205.56	20.6	69.8	19.7	10.7
7月末	17,049	11.8	192.25	12.8	66.6	22.6	10.9
8月末	17,010	11.5	191.91	12.6	67.3	21.3	11.4
9月末	16,859	10.5	190.89	12.0	64.9	23.5	11.5
10月末	17,552	15.1	197.85	16.1	62.0	27.1	11.3
(期 末) 2021年11月30日	16,743	9.8	189.30	11.1	56.5	34.1	10.1

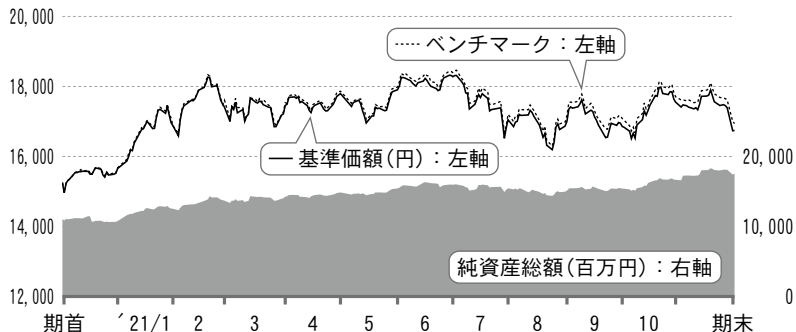
※騰落率は期首比です。

※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12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	15,253円
期末	16,743円
騰落率	+9.8%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

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

▶ 基準価額の主な変動要因（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

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

上昇要因

- ・米国大統領選で民主党のバイデン氏が勝利し、大型経済対策が成立したことなどをを受け、期初から2021年2月中旬にかけて新興国株式市場が上昇したこと
- ・新型コロナウイルスワクチン接種進捗に伴う経済活動の再開や回復期待から、株式市場が上昇したこと
- ・香港ドルや台湾ドルが円に対して上昇したこと

下落要因

- ・中国におけるウイルス感染の拡大や、政府によるIT、不動産、教育などの産業への規制強化懸念から、中国や香港の株式市場が下落したこと

▶ 投資環境について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

新興国株式市場は上昇しました。米ドル、香港ドルや新興国通貨は対円で上昇しました。

新興国株式市場

米国大統領選で民主党のバイデン氏が勝利し、大型経済対策を打ち出したことから景気回復への信頼感が高まり、新興国株式市場も期初から2021年2月中旬にかけて上昇しました。新型コロナウイルスに対する開発中の複数のワクチンが高い有効性を示したことも下支えになりました。2月下旬以降は、米国の長期金利の上昇を受けた投資家心理の悪化や、一部の国での感染再拡大などから、新興国株式市場は下落しました。

期末にかけては、国や地域でまちまちな動きとなりました。中国では感染拡大に加え、政府によるIT大手企業、不動産、教育などの産業への規制強化や大手不動産グループの経営不安もマイナス材料となりました。一方でワクチン接種の進展に伴う世界景気回復を好感して台湾などは上昇しました。また、ワクチン接種の進捗や経済活動制限の緩和措置などを好感してインドの株式市場は上昇しました。

為替市場

米ドル・円相場は、米国の景気回復期待や長期金利の上昇を受けて米ドルを買う動きが優勢となり、3月末まで急激な米ドル高・円安が進行しました。4月は長期金利の落ち着きとともに、一時的に米ドル安・円高となったものの、4月下旬からは再度、米ドル高・円安の動きとなりました。9月以降は、米国のFOMC（米連邦公開市場委員会）会合を経て、量的緩和策を縮小するとの見方が広がり、米ドルは円などの主要通貨に対してさらに上昇しました。

アジアの主要通貨も一部を除いて、米ドル・円の動きに連れて、円に対して上昇しました。

▶ ポートフォリオについて（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

株式組入比率

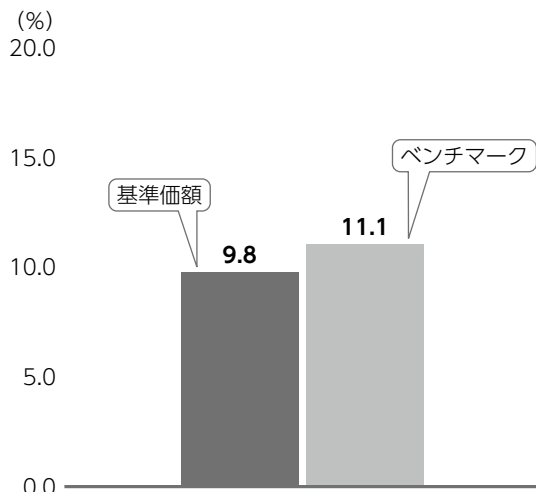
期を通じて、株式、投資信託証券および先物の組入れにより、実質株式組入比率は100%に近い高位を保ちました。

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。

▶ ベンチマークとの差異について（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドはMSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

当期における基準価額の騰落率は+9.8%となり、ベンチマークの騰落率+11.1%から1.3%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 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) (投 資 信 託 証 券)	17円 (12) (0) (4) (1)	0.101% (0.069) (0.000) (0.024) (0.008)	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) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券)	4 (4) (0) (0)	0.021 (0.021) (0.000) (0.000)	有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	18 (17) (1)	0.105 (0.100) (0.005)	その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数 保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 そ の 他:信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	39	0.227	

期中の平均基準価額は17,214円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 982.38 (169.29)	千アメリカ・ドル 5,090 (-)	百株 370.31	千アメリカ・ドル 5,750
	香 港	34,694.5 (△ 446.65)	千香港・ドル 106,189 (△ 72)	9,860.86	千香港・ドル 8,596
	台 湾	11,185 (370.99)	千台湾・ドル 105,879 (△ 457)	1,440.09	千台湾・ドル 6,359
	エ ジ プ ト	165.29 (55.37)	千エジプト・ポンド 368 (-)	98.94	千エジプト・ポンド 95
	ト ル コ	623.15	千トルコ・リラ 704	508.41	千トルコ・リラ 274
	メ キ シ コ	2,042.15 (353)	千メキシコ・ペソ 7,527 (△ 55)	911	千メキシコ・ペソ 1,788

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	フ ィ リ ピ ン	2,321.75	千フィリピン・ペソ 8,826	2,348.5	千フィリピン・ペソ 1,622
	チ リ	8,976.12 (3.09)	千チリ・ペソ 97,715 (-)	2,820.33	千チリ・ペソ 42,704
	コ ロ ン ビ ア	145.05	千コロンビア・ペソ 150,866	10.96	千コロンビア・ペソ 24,760
	イ ン ド	4,923.1 (135.51)	千インド・ルピー 289,759 (△ 39)	219.35	千インド・ルピー 9,891
	イ ン ド ネ シ ア	19,332 (7,654.73)	千インドネシア・ルピア 6,956,040 (-)	5,534.73	千インドネシア・ルピア 654,275
	ブ ラ ジ ル	2,418.52 (1,116.71)	千ブラジル・レアル 7,999 (-)	818.26	千ブラジル・レアル 1,277
	チ ェ コ	6.45	千チェコ・コルナ 362	18	千チェコ・コルナ 156
	韓 国	657.77 (78.18)	千韓国・ウォン 4,527,127 (-)	99.24	千韓国・ウォン 411,880
	マ レ ー シ ア	2,693 (1,499.68)	千マレーシア・リングgit 1,566 (-)	492.33	千マレーシア・リングgit 182
	南 ア フ リ カ	1,105.14 (8.37)	千南アフリカ・ランド 15,661 (-)	330.3	千南アフリカ・ランド 7,934
	タ イ	3,882 (65)	千タイ・バーツ 17,551 (△ 24)	3,192	千タイ・バーツ 5,768
	ポ ー ラ ン ド	170.28	千ポーランド・ズロチ 713	13.68	千ポーランド・ズロチ 68
	ハ ン ガ リ ー	37.69	千ハンガリー・フォリント 20,910	0.38	千ハンガリー・フォリント 674
	ユ ー ロ		千ユーロ		千ユーロ
国	ギ リ シ ャ	695.81	111	7.46	8

※金額は受渡し代金。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

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 15,996	千タイ・パーツ 24	証券 6,936	千タイ・パーツ 21

※金額は受渡し代金。

(3) 公社債

			買 付 額	売 付 額
外国	イ	ン ド 社 債 券	千インド・ルピー 39	千インド・ルピー 37

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(4) 投資信託証券

		買 付		売 付		
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外 国	ア メ リ カ	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	□ 25,301	千アメリカ・ドル 876	□ 2,687	千アメリカ・ドル 105
		GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	□ 207	□ 6	□ 83	□ 2
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	□ 26,129	□ 1,019	□ 628	□ 28
		ISHARES MSCI UAE ETF	□ 25,554	□ 349	□ 2,408	□ 31
		ISHARES MSCI QATAR ETF	□ 8,115	□ 147	□ 78	□ 1
		ISHARES MSCI KUWAIT ETF	□ 18,439	□ 497	□ -	□ -
	メ キ シ コ	TRUST FIBRA UNO	□ -	千メキシコ・ペソ -	□ -	千メキシコ・ペソ -
			(-)	(△) 10	(-)	(-)
		CEMEX SAB-CPO	□ 46,900	□ 712	□ -	□ -
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	□ 2,270	□ 207	□ -	□ -
		GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	□ 6,800	□ 359	□ -	□ -
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	□ 7,000	□ 1,052	□ 300	□ 52
	ブ ラ ジ ル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	□ 1,700	千ブラジル・レアル 190	□ -	千ブラジル・レアル -
			(12,000)	(-)	(-)	(-)
		BANCO INTER SA-UNITS	□ 1,400	□ 218	□ -	□ -
			(2,800)	(-)	(-)	(-)
		GETNET ADQUIRENCIA E SERVICIO	□ -	□ -	□ -	□ -
			(1,575)	(-)	(-)	(-)
		KLABIN SA - UNIT	□ 1,700	□ 50	□ -	□ -
	中 国	SUL AMERICA SA - UNITS	□ -	□ -	□ 3,240	□ 109
		(184)	(-)	(-)	(-)	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		□ 2,100	□ 84	□ -	□ -	
南 ア フ リ カ	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	□ 239,400	千オフショア・人民元 12,694	□ 11,200	千オフショア・人民元 625	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	□ 17,188	千南アフリカ・ランド 204	□ -	千南アフリカ・ランド -	

※金額は受渡し代金。

※()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(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	百万円 21,268	百万円 18,678	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

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

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	4,872,089千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	9,763,344千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	0.49

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2021年11月30日現在)

(1) 外国株式

銘柄	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	千アメリカ・ドル	千円	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15.59	208.08	44	5,113	消費者サービス
BAIDU INC - SPON ADR	27.88	36.8	553	62,922	メディア・娯楽
YUM CHINA HOLDINGS INC	40.58	56.7	286	32,556	消費者サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	22.17	29.09	20	2,316	素材
SOUTHERN COPPER CORP	8.76	10.88	64	7,372	素材
SINA CORP	5.56	-	-	-	メディア・娯楽
NETEASE INC-ADR	42.1	54.21	596	67,916	メディア・娯楽
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	8.92	-	-	-	電気通信サービス
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	48.52	68.27	185	21,064	消費者サービス
CREDICORP LTD	7.02	9.11	107	12,279	銀行
YPF S. A. -SPONSORED ADR	13.87	26.32	8	1,015	エネルギー
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	45.24	60.3	58	6,627	小売
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	192.21	-	-	-	小売
JD.COM INC-ADR	87.47	116.57	1,024	116,587	小売
VNET GROUP INC-ADR	-	11.66	12	1,390	ソフトウェア・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	38.76	55.71	27	3,169	消費者サービス
JOYY INC-ADR	5.91	7.58	40	4,553	メディア・娯楽
HELLO GROUP INC -SPN ADR	15.51	21.59	25	2,922	メディア・娯楽
AUTOHOME INC-ADR	6.09	9.27	32	3,696	メディア・娯楽
WEIBO CORP-SPON ADR	4.88	8.41	33	3,789	メディア・娯楽
HUAZHU GROUP LTD-ADR	16.24	24.07	94	10,721	消費者サービス
HUYA INC-ADR	6.61	11.53	9	1,031	メディア・娯楽
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	12.06	21.78	147	16,743	メディア・娯楽
PINDUODUO INC-ADR	27.88	59.14	425	48,417	小売
BAOZUN INC-SPN ADR	4.54	8.38	12	1,414	小売
GDS HOLDINGS LTD - ADR	8.08	12.03	66	7,616	ソフトウェア・サービス
51JOB INC-ADR	2.28	3.58	19	2,240	商業・専門サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2.31	3.77	14	1,597	各種金融
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	41.44	58.2	180	20,513	運輸
NIO INC - ADR	109.08	182.31	737	83,919	自動車・自動車部品
XPENG INC - ADR	10.61	51.76	265	30,244	自動車・自動車部品
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	-	7.87	45	5,194	半導体・半導体製造装置
LI AUTO INC - ADR	-	72.34	249	28,377	自動車・自動車部品
DIDI GLOBAL INC	-	41	32	3,643	運輸
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	70.8	148.8	13	1,523	不動産
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	68	-	-	-	エネルギー
BEIGENE LTD-ADR	-	6.17	211	24,091	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEST INC-ADR	18.16	-	-	-	運輸
GAOTU TECHEDU INC	7.9	16.59	4	520	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	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	
HUTCHMED CHINA-ADR	7.06	10.66	36	4,127	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IQIYI INC-ADR	23.1	36.43	23	2,644	メディア・娯楽	
KE HOLDINGS INC-ADR	9.36	49.09	104	11,862	不動産	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	—	6.08	10	1,220	ソフトウェア・サービス	
LUFAX HOLDING LTD-ADR	17.42	23.25	14	1,677	各種金融	
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	—	82.87	42	4,780	食品・飲料・タバコ	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	37.72	90.09	62	7,143	メディア・娯楽	
ZAI LAB LTD-ADR	6.98	10.53	76	8,674	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AGORA INC-ADR	—	6.8	14	1,596	ソフトウェア・サービス	
BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	—	5.88	8	970	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	—	15.2	14	1,705	ソフトウェア・サービス	
DADA NEXUS LTD-ADR	—	7.99	17	1,941	小売	
I-MAB-SPONSORED ADR	—	4.71	29	3,405	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	—	15.78	3	452	ソフトウェア・サービス	
360 DIGITECH INC	—	11.6	27	3,144	各種金融	
UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	—	10.71	6	739	各種金融	
ADECOAGRO SA	—	16.98	13	1,501	食品・飲料・タバコ	
GLOBALANT SA	3.79	5.3	144	16,398	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,148.46 41銘柄	1,929.82 52銘柄	6,302 —	717,088 <4.1%>	
(香港)			千香港・ドル			
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,060	1,450	817	11,931	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	245	—	—	—	資本財	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	450	450	168	2,455	資本財	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	70	85	270	3,949	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	360	360	152	2,227	各種金融	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	430	530	276	4,036	商業・専門サービス	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	75	—	—	—	資本財	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	240	350	805	11,744	ソフトウェア・サービス	
KINGSOFT CORP LTD	80	130	454	6,628	メディア・娯楽	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	900	900	111	1,628	各種金融	
WHARF HOLDINGS LTD	170	170	472	6,895	不動産	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	161.4	161.4	195	2,849	運輸	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	600	600	171	2,494	公益事業	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	70	100	395	5,770	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	510	670	435	6,353	食品・飲料・タバコ	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	130	130	111	1,623	運輸	
CHINA EVERBRIGHT LTD	80	80	66	968	各種金融	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	50	75	300	4,377	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	600	790	1,892	27,605	自動車・自動車部品	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	100	220	169	2,471	運輸	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	130	130	98	1,443	食品・飲料・タバコ	
CGN POWER CO LTD-H	930	1,670	357	5,214	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	
CHINA VANKE CO LTD-H	185	221	401	5,855	不動産
SSY GROUP LTD	100	100	37	542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	50	60	296	4,328	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	140	200	1,310	19,112	食品・飲料・タバコ
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	260	330	463	6,759	不動産
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	340	520	385	5,621	ヘルスケア機器・サービス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,100	1,100	89	1,299	メディア・娯楽
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	200	260	410	5,993	食品・飲料・タバコ
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	-	125	140	2,053	不動産
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	-	120	270	3,939	素材
BAIC MOTOR CORP LTD-H	155	-	-	-	自動車・自動車部品
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	150	150	112	1,641	不動産
JIANGXI COPPER CO LTD-H	120	140	179	2,614	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	50	-	-	-	資本財
CHINA GAS HOLDINGS LTD	278	432	758	11,067	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,480	3,380	1,189	17,358	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	60	60	162	2,372	公益事業
LUYE PHARMA GROUP LTD	185	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	220	420	159	2,328	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MINTH GROUP LTD	-	100	365	5,332	自動車・自動車部品
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	120	120	40	588	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	-	340	432	6,309	ソフトウェア・サービス
YIHA! INTERNATIONAL HOLDING	50	60	258	3,772	食品・飲料・タバコ
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	320	320	232	3,398	自動車・自動車部品
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	990	1,980	132	1,935	小売
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	170	210	794	11,596	資本財
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	140	246	279	4,084	各種金融
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	60	-	-	-	運輸
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	200	200	76	1,111	資本財
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	120	120	84	1,239	運輸
SHENZHEN INVESTMENT LTD	420	420	76	1,121	不動産
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	-	190	154	2,253	資本財
FOSUN INTERNATIONAL LTD	235	315	271	3,966	資本財
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	180	-	-	-	運輸
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	-	80	299	4,371	小売
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	200	200	90	1,324	運輸
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	80	120	155	2,262	ソフトウェア・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	586	771	35,651	520,148	メディア・娯楽
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	120	260	101	1,483	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	140	210	998	14,568	不動産
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,340	-	-	-	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	1,076	1,922	3,709	54,121	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIR CHINA LTD-H	160	320	161	2,353	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	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	—	110	209	3,062	不動産
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	620	—	—	—	電気通信サービス
ZTE CORP-H	78	102	222	3,244	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	100	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	135	185	169	2,469	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	620	620	145	2,116	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	220	260	533	7,776	公益事業
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	—	90	294	4,293	ヘルスケア機器・サービス
PETROCHINA CO LTD-H	2,160	2,980	1,016	14,826	エネルギー
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	170	170	219	3,209	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN-CLASS B	365	540	13,230	193,025	小売
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	60	85	552	8,060	小売
CNOOC LTD	1,830	—	—	—	エネルギー
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	60	120	175	2,559	消費者サービス
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	—	2,033	26,429	385,599	小売
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	—	200	227	3,320	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	440	440	151	2,214	公益事業
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	—	480	5,107	74,514	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	125	175	637	9,293	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	270	450	738	10,767	公益事業
LOGAN GROUP CO LTD	160	160	126	1,844	不動産
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	300	420	182	2,665	不動産
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,020	1,150	622	9,077	銀行
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	110	210	191	2,794	小売
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,830	12,880	6,530	95,275	銀行
CHINA MOBILE LTD	630	—	—	—	電気通信サービス
CHINA FEIHE LTD	120	500	531	7,747	食品・飲料・タバコ
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	—	14	177	2,587	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	166	222	244	3,562	保険
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	420	660	900	13,134	半導体・半導体製造装置
KWG LIVING GROUP HOLDINGS LT	62.5	—	—	—	不動産
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	360	—	—	—	半導体・半導体製造装置
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	—	47	322	4,710	小売
HAIER SMART HOME CO LTD-H	—	302	868	12,667	耐久消費財・アパレル
KUAISHOU TECHNOLOGY	—	37	316	4,615	メディア・娯楽
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,540	5,780	578	8,433	電気通信サービス
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	910	1,200	406	5,935	銀行
WUXI APPTTEC CO LTD-H	27.76	44.11	760	11,101	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	—	50	115	1,677	ソフトウェア・サービス
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	90	140	246	3,594	消費者サービス
WEIMOB INC	—	210	199	2,913	ソフトウェア・サービス
CHINA YOUZAN LTD	—	1,720	122	1,781	ソフトウェア・サービス
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	—	100	134	1,957	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	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	65	80	308	4,499	家庭用品・パーソナル用品
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	—	90	147	2,153	消費者サービス
NONGFU SPRING CO LTD-H	—	44	204	2,978	食品・飲料・タバコ
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	240	240	106	1,554	運輸
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	350	460	760	11,100	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	928	1,208	999	14,575	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOPHARM GROUP CO-H	136	188	344	5,030	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES LAND LTD	320	440	1,509	22,019	不動産
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	130	130	67	978	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	120	—	—	—	耐久消費財・アパレル
YANZHOU COAL MINING CO-H	160	200	244	3,565	エネルギー
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	100	120	499	7,292	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LTD	240	240	146	2,135	運輸
MMG LTD	—	320	90	1,321	素材
BYD CO LTD-H	65	105	3,173	46,295	自動車・自動車部品
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,830	3,400	884	12,897	銀行
CHINA RESOURCES CEMENT	260	380	219	3,199	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	85	114	242	3,542	保険
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	850	1,270	294	4,298	保険
CITIC LTD	630	770	551	8,043	資本財
IND & COMM BK OF CHINA-H	6,210	7,550	3,140	45,824	銀行
CIFI HOLDINGS GROUP C-RTS	—	21	1	16	不動産
GUANGDONG INVESTMENT LTD	320	400	433	6,326	公益事業
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	405	490	896	13,082	不動産
CRRC CORP LTD - H	420	—	—	—	資本財
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	410	—	—	—	資本財
KWG GROUP HOLDINGS LTD	125	125	75	1,107	不動産
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	100	100	79	1,164	素材
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	70	70	152	2,221	資本財
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	70	120	164	2,402	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	220	429	552	8,061	運輸
YUEXIU PROPERTY CO LTD	880	176	128	1,869	不動産
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	596	801	242	3,541	銀行
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	790	990	692	10,096	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	75	90	307	4,484	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	110	140	1,720	25,103	耐久消費財・アパレル
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	100	150	168	2,451	資本財
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	40	80	528	7,703	食品・飲料・タバコ
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	66.18	104.18	180	2,629	資本財
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	180	—	—	—	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	332	392	303	4,432	自動車・自動車部品
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	87	112	1,702	24,838	耐久消費財・アパレル
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	130	130	71	1,037	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	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	610	855	4,749	69,295	保険
CHINA MENGNIU DAIRY CO	280	430	1,965	28,670	食品・飲料・タバコ
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	700	920	625	9,127	保険
LI NING CO LTD	215	300	2,583	37,685	耐久消費財・アパレル
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	350	415	1,384	20,192	自動車・自動車部品
WEICHAI POWER CO LTD-H	180	240	331	4,839	資本財
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	260	260	137	2,010	資本財
CHINA POWER INTERNATIONAL	370	370	148	2,159	公益事業
SUNNY OPTICAL TECH	73	96	2,280	33,279	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	400	520	197	2,882	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	284	340	787	11,483	保険
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	77	77	111	1,619	ヘルスケア機器・サービス
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	760	1,000	1,308	19,083	保険
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	84	106	1,590	23,198	公益事業
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	140	210	186	2,723	素材
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	260	—	—	—	資本財
KUNLUN ENERGY CO LTD	440	580	426	6,219	公益事業
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	172	268	110	1,610	不動産
CHINA OILFIELD SERVICES-H	140	260	163	2,382	エネルギー
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	580	760	778	11,354	素材
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	80	—	—	—	エネルギー
LENOVO GROUP LTD	740	1,020	781	11,399	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	180	340	265	3,869	資本財
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	400	480	415	6,057	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	900	1,080	502	7,327	銀行
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	40	40	86	1,260	家庭用品・パーソナル用品
CHINA EVERGRANDE GROUP	200	270	61	898	不動産
FAR EAST HORIZON LTD	180	280	193	2,822	各種金融
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	190	—	—	—	不動産
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	120	120	61	901	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	240	240	63	920	銀行
SINOTRUK HONG KONG LTD	65	100	116	1,704	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	66	66	335	4,891	資本財
CHINA MERCHANTS BANK-H	400	525	3,199	46,686	銀行
BANK OF CHINA LTD-H	8,120	10,710	2,923	42,658	銀行
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	360	360	167	2,442	素材
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	260	440	237	3,460	耐久消費財・アパレル
SOHO CHINA LTD	245	—	—	—	不動産
CITIC SECURITIES CO LTD-H	220	330	601	8,782	各種金融
SUN ART RETAIL GROUP LTD	245	245	76	1,111	食品・生活必需品小売り
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	280	428	281	4,102	各種金融
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	11	15	160	2,341	食品・飲料・タバコ
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	210	500	51	751	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	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	340	340	92	1,344	銀行
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	50	—	—	—	各種金融
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	—	62.5	88	1,294	素材
A-LIVING SMART CITY SERVICES	50	70	128	1,879	不動産
INNOVENT BIOLOGICS INC	95	160	1,139	16,620	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
POLY PROPERTY SERVICES CO-H	12	12	62	913	不動産
CANSINO BIOLOGICS INC-H	6	10	160	2,341	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	—	20	319	4,660	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	—	275	67	983	銀行
GF SECURITIES CO LTD-H	106	170	234	3,427	各種金融
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	48	92	396	5,778	自動車・自動車部品
LEGEND HOLDINGS CORP-H	49	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	920	920	72	1,060	各種金融
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	300	—	—	—	保険
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	38	67	184	2,688	保険
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	136	184	340	4,971	各種金融
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	—	30	113	1,654	ヘルスケア機器・サービス
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	—	50	166	2,429	半導体・半導体製造装置
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	—	34	495	7,232	素材
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	300	300	168	2,464	自動車・自動車部品
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	240	360	396	5,777	ヘルスケア機器・サービス
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	190	255	984	14,360	不動産
BOC AVIATION LTD	19	35	193	2,829	資本財
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	—	250	116	1,692	不動産
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	115	310	231	3,383	素材
YUZHOU GROUP HOLDINS CO LTD	170	—	—	—	不動産
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180	180	131	1,919	不動産
GENSCRIPT BIOTECH CORP	100	160	648	9,454	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	25	—	—	—	消費者サービス
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	140	140	62	908	不動産
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53	61	181	2,652	ヘルスケア機器・サービス
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	40	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	84	152	253	3,703	消費者サービス
CHINA AOYUAN GROUP LTD	90	180	36	533	不動産
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	40	100	81	1,186	消費者サービス
HANSON PHARMACEUTICAL GROUP	120	180	290	4,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	—	240	1,190	17,367	食品・飲料・タバコ
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	8.36	100	128	1,870	不動産
AKESO INC	—	40	199	2,912	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	—	360	114	1,665	小売
SEAZEN GROUP LTD	200	320	180	2,628	不動産
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	315	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3SBIO INC	105	170	113	1,654	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	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 LITERATURE LTD		30	54	297	4,345	メディア・娯楽
DALI FOODS GROUP CO LTD		195	195	79	1,155	食品・飲料・タバコ
YADEA GROUP HOLDINGS LTD		—	140	190	2,773	自動車・自動車部品
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD		—	100	97	1,425	不動産
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY		—	86	333	4,868	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	90,502.2	114,889.19	185,639	2,708,480	
		206銘柄	213銘柄	—	<15.4%>	
(台湾)				千台湾・ドル		
SILERGY CORP		10	10	4,470	18,302	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD		126.32	174.63	4,226	17,303	各種金融
ADVANTECH CO LTD		42.99	52.99	1,992	8,158	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORMOSA TAFFETA CO.		80	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD		20	30	1,767	7,235	耐久消費財・アパレル
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD		20	20	785	3,214	耐久消費財・アパレル
GLOBALWAFERS CO LTD		20	30	2,478	10,146	半導体・半導体製造装置
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT		340	450	4,545	18,609	半導体・半導体製造装置
WIWYNN CORP		10	10	1,020	4,176	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOMO.COM INC		—	10	1,660	6,797	小売
TAIWAN CEMENT		520.77	670.77	3,119	12,771	素材
ASIA CEMENT CORP		220	290	1,231	5,040	素材
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO		490	650	4,374	17,911	食品・飲料・タバコ
STANDARD FOODS CORP		20	—	—	—	食品・飲料・タバコ
FORMOSA PLASTICS CORP		400	520	5,356	21,930	素材
NAN YA PLASTICS CORP		540	710	5,871	24,042	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE		370	490	3,885	15,910	素材
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP		250	350	985	4,034	資本財
CHINA STEEL CORP		1,260	1,580	5,198	21,284	素材
HIWIN TECHNOLOGIES CORP		31.21	32.14	896	3,671	資本財
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD		210	210	714	2,923	自動車・自動車部品
HOTAI MOTOR COMPANY LTD		30	40	2,448	10,023	小売
LITE-ON TECHNOLOGY CORP		240	310	1,878	7,692	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNITED MICROELECTRONICS CORP		1,190	1,590	9,921	40,624	半導体・半導体製造装置
DELTA ELECTRONICS INC		200	260	6,591	26,987	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HON HAI PRECISION INDUSTRY		1,278	1,678	17,367	71,112	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS		370	530	1,237	5,067	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YAGEO CORPORATION		41.98	51.98	2,388	9,779	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		2,520	3,300	195,690	801,272	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP		200	450	1,390	5,693	半導体・半導体製造装置
ACCTON TECHNOLOGY CORP		60	70	2,033	8,326	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP		160	160	926	3,793	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC		340	340	945	3,870	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD		70	110	715	2,927	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVENTEC CORP		240	420	1,094	4,479	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

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	
ASUSTEK COMPUTER INC	80	100	3,555	14,556	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60	80	1,292	5,290	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50	60	3,216	13,168	半導体・半導体製造装置
QUANTA COMPUTER INC	310	370	3,204	13,119	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	70.1	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	100	140	1,026	4,201	半導体・半導体製造装置
AU OPTRONICS CORP	780	1,070	2,209	9,047	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	390	510	5,737	23,492	電気通信サービス
MEDIA TEK INC	150	200	20,600	84,348	半導体・半導体製造装置
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	70	90	1,341	5,490	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	66	—	—	—	不動産
EVERGREEN MARINE CORP LTD	227.4	337.4	4,048	16,578	運輸
YANG MING MARINE TRANSPORT	—	210	2,310	9,458	運輸
WAN HAI LINES LTD	—	77	1,178	4,823	運輸
EVA AIRWAYS CORP	188.97	—	—	—	運輸
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	481.03	657.54	1,098	4,496	銀行
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	228.32	237.45	723	2,960	保険
TAIWAN BUSINESS BANK	465.02	—	—	—	銀行
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	851.33	1,058.55	2,164	8,863	銀行
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	680	990	7,276	29,794	保険
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	810	1,070	6,345	25,980	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,300	1,820	2,948	12,072	保険
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,158.6	1,622.01	4,411	18,064	銀行
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	991.6	1,311.6	3,187	13,050	各種金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,110	1,470	4,983	20,404	銀行
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,004.85	1,259.58	2,292	9,386	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,134.32	1,484.32	1,580	6,472	保険
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,037.6	1,247.6	1,871	7,662	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	1,790	2,520	6,123	25,073	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,054.08	1,397.92	3,257	13,336	銀行
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	60	80	2,220	9,090	食品・生活必需品小売り
LARGAN PRECISION CO LTD	10.8	10.8	2,154	8,822	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	60	80	3,760	15,395	半導体・半導体製造装置
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	—	160	3,408	13,954	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	170	220	2,160	8,845	電気通信サービス
WISTRON CORP	252.93	352.93	1,034	4,234	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INNOLUX CORP	950	1,180	2,106	8,624	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD	155.2	245.2	1,224	5,014	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	160	220	1,375	5,630	電気通信サービス
PEGATRON CORP	220	270	1,809	7,407	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	100	120	1,794	7,345	半導体・半導体製造装置
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	955.94	1,281.05	3,016	12,352	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	60	100	972	3,979	半導体・半導体製造装置

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	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	110	140	1,360	5,571	エネルギー
WALSIN TECHNOLOGY CORP	30	40	704	2,882	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	170	290	855	3,502	運輸
WIN SEMICONDUCTORS CORP	30	40	1,458	5,969	半導体・半導体製造装置
ONENESS BIOTECH CO LTD	—	30	826	3,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	—	5	927	3,797	半導体・半導体製造装置
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	342.99	482.99	2,209	9,047	銀行
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	—	30	1,752	7,173	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHISON ELECTRONICS CORP	10	20	835	3,418	半導体・半導体製造装置
POU CHEN	190	260	851	3,486	耐久消費財・アパレル
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	46.4	56.4	1,133	4,641	耐久消費財・アパレル
GIANT MANUFACTURING	30	40	1,270	5,200	耐久消費財・アパレル
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	87	121.8	777	3,181	不動産
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10	20	1,644	6,731	資本財
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	70	70	688	2,820	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	32,841.75 86銘柄	42,957.65 87銘柄	441,513 —	1,807,822 <10.3%>
(エジプト)			千エジプト・ポンド		
EASTERN CO SAE	86.1	135.58	145	1,050	食品・飲料・タバコ
ELSWEDY ELECTRIC CO	54.55	—	—	—	資本財
COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	148.6	221.49	1,127	8,163	銀行
FAWRY FOR BANKING & PAYMENT	—	53.9	65	472	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	289.25 3銘柄	410.97 3銘柄	1,337 —	9,685 <0.1%>
(トルコ)			千トルコ・リラ		
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	84.52	84.52	192	1,715	資本財
HACI OMER SABANCI HOLDING	71.57	—	—	—	各種金融
TURKIYE GARANTI BANKASI	272.08	354.53	404	3,607	銀行
AKBANK T. A. S.	293.34	393.34	259	2,317	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C	96.81	223.89	148	1,324	銀行
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	89.01	155.66	287	2,567	電気通信サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	10.04	15.04	233	2,086	エネルギー
TURK HAVA YOLLARI AO	44.73	—	—	—	運輸
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	140.96	224.34	275	2,461	資本財
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	22.05	—	—	—	食品・飲料・タバコ
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	7.34	9.47	233	2,083	自動車・自動車部品
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	126.06	197.52	451	4,026	素材
KOC HOLDING AS	61.07	91.07	264	2,359	資本財
YAPI VE KREDI BANKASI	322.06	—	—	—	銀行
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	50.02	57.02	396	3,534	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	1,691.66 15銘柄	1,806.4 11銘柄	3,146 —	28,084 <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
(メキシコ)						
BECLE SAB DE CV	60	60	千メキシコ・ペソ	285	1,499	食品・飲料・タバコ
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	43	—	—	—	—	公益事業
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	17.5	30.5	457	2,401	2,401	運輸
TELESITES SAB DE CV	—	147	277	1,457	1,457	電気通信サービス
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	43	50	1,248	6,557	6,557	運輸
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	3,468	4,595	8,532	44,822	44,822	電気通信サービス
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	176	176	587	3,086	3,086	家庭用品・パーソナル用品
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	549	711	4,962	26,065	26,065	食品・生活必需品小売り
GRUMA S. A. B. -B	19.2	24.65	633	3,327	3,327	食品・飲料・タバコ
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	11.95	16.95	435	2,286	2,286	素材
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	36	77	452	2,379	2,379	資本財
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	331	432	3,792	19,919	19,919	素材
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	202	282	567	2,980	2,980	銀行
ALFA S. A. B. -A	353	—	—	—	—	資本財
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	86	117	592	3,110	3,110	素材
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	151	196	1,035	5,437	5,437	食品・飲料・タバコ
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43	70	929	4,883	4,883	食品・飲料・タバコ
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	19.85	26.55	1,041	5,469	5,469	運輸
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	265	347	4,370	22,959	22,959	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,874.5 18銘柄	7,358.65 17銘柄	30,201 —	158,643 <0.9%>	
(フィリピン)						
AYALA LAND INC	882	1,176	千フィリピン・ペソ	4,057	9,163	不動産
PUREGOLD PRICE CLUB INC	61	—	—	—	—	食品・生活必需品小売り
PLDT INC	8.3	12.55	2,108	4,761	4,761	電気通信サービス
METROPOLITAN BANK & TRUST	130.4	242.4	1,209	2,731	2,731	銀行
MANILA ELECTRIC COMPANY	23.4	23.4	673	1,522	1,522	公益事業
SM PRIME HOLDINGS INC	1,088	1,314	4,914	11,099	11,099	不動産
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	77.37	225.27	2,049	4,629	4,629	銀行
AYALA CORPORATION	31.1	37.9	3,168	7,155	7,155	資本財
JOLLIBEE FOODS CORP	41.1	74.8	1,757	3,969	3,969	消費者サービス
UNIVERSAL ROBINA CORP	101.8	101.8	1,353	3,057	3,057	食品・飲料・タバコ
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	117.7	117.7	2,329	5,260	5,260	運輸
MEGAWORLD CORP	920	—	—	—	—	不動産
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	164.5	266.5	1,308	2,955	2,955	資本財
GLOBE TELECOM INC	3.35	3.35	1,099	2,483	2,483	電気通信サービス
SM INVESTMENTS CORP	26.45	32.05	3,140	7,093	7,093	資本財
BDO UNIBANK INC	220.2	286.7	3,555	8,029	8,029	銀行
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	1,109	1,109	450	1,016	1,016	各種金融
ABOITIZ POWER CORP	120	—	—	—	—	公益事業
GT CAPITAL HOLDINGS INC	6	13.1	746	1,686	1,686	資本財

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数・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	
JG SUMMIT HOLDINGS INC		334.42	402.82	2,277	5,144	資本財
小計		5,466.09	5,439.34	36,201	81,761	
		20銘柄	17銘柄	—	< 0.5% >	
(チリ)				千チリ・ペソ		
CENCOSUD SHOPPING SA		55.23	55.23	4,909	663	不動産
ENEL CHILE SA		2,275.42	3,648.77	13,752	1,857	公益事業
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM		12	—	—	—	電気通信サービス
BANCO DE CREDITO E INVERSION		6.4	6.71	18,788	2,537	銀行
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		15.86	15.86	10,531	1,422	食品・飲料・タバコ
BANCO DE CHILE		5,043.08	6,086.4	48,691	6,575	銀行
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		12.73	18.3	98,673	13,325	素材
ENEL AMERICAS SA		3,728.02	2,637.07	28,480	3,846	公益事業
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B		33.86	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CENCOSUD SA		125.37	183.17	23,262	3,141	食品・生活必需品小売り
FALABELLA SA		72.91	101.23	27,332	3,691	小売
COLBUN SA		617.05	1,241.12	6,473	874	公益事業
EMPRESAS CMPC SA		130.85	130.85	18,388	2,483	素材
EMPRESAS COPEC SA		44.47	58.18	37,526	5,067	エネルギー
AGUAS ANDINAS SA-A		203.35	—	—	—	公益事業
BANCO SANTANDER CHILE		5,677.31	10,029.9	37,662	5,086	銀行
小計		18,053.91	24,212.79	374,471	50,572	
		16銘柄	13銘柄	—	< 0.3% >	
(コロンビア)				千コロンビア・ペソ		
ECOPETROL SA		523.63	616.93	160,093	4,514	エネルギー
BANCOLOMBIA SA		22.12	36.56	111,142	3,134	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		46.23	55.54	170,785	4,816	銀行
INTERCONEXION ELECTRICA SA		42.29	59.33	124,593	3,513	公益事業
GRUPO DE INV SURAMERICANA		29.86	29.86	72,858	2,054	各種金融
小計		664.13	798.22	639,472	18,034	
		5銘柄	5銘柄	—	< 0.1% >	
(インド)				千インド・ルピー		
YES BANK LTD		—	1,118.06	1,358	2,078	銀行
IPCA LABORATORIES LTD		—	9.18	1,946	2,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INFOSYS LTD		348.41	456.4	77,421	118,454	ソフトウェア・サービス
BHARAT ELECTRONICS LTD		—	191.31	3,773	5,773	資本財
HAVELLS INDIA LTD		22.21	30.11	4,004	6,127	資本財
VEDANTA LTD		209.44	149.89	5,198	7,953	素材
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD		72.26	109.03	7,453	11,404	保険
TECH MAHINDRA LTD		47.42	81.14	12,468	19,076	ソフトウェア・サービス
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA		35.24	48.42	2,843	4,350	保険
SBI LIFE INSURANCE CO LTD		40.9	60.7	6,897	10,552	保険
SHREE CEMENT LTD		0.82	1.46	3,732	5,710	素材
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD		41.45	80.79	6,188	9,468	食品・飲料・タバコ

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	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	
MRF LTD	—	0.21	1,550	2,371	自動車・自動車部品
INDIAN OIL CORP LTD	192.53	290.88	3,455	5,287	エネルギー
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	—	9.71	2,100	3,213	自動車・自動車部品
DIVI'S LABORATORIES LTD	8.14	17.9	8,809	13,478	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUROBINDO PHARMA LTD	26.83	36.11	2,364	3,618	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOCON LTD	29.3	46.86	1,707	2,612	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PETRONET LNG LTD	61.35	88.94	1,956	2,993	エネルギー
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	9.09	14.4	3,433	5,253	各種金融
BHARAT FORGE LTD	20.03	34.65	2,415	3,695	自動車・自動車部品
PIDILITE INDUSTRIES LTD	14.14	20.56	4,560	6,977	素材
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	5.02	5.56	1,688	2,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INFO EDGE INDIA LTD	6.26	10.41	6,085	9,310	メディア・娯楽
PAGE INDUSTRIES LTD	0.46	0.82	3,118	4,771	耐久消費財・アパレル
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	44	73.91	5,192	7,945	運輸
JUBILANT FOODWORKS LTD	7.18	10.66	3,880	5,937	消費者サービス
MUTHOOT FINANCE LTD	—	13.43	1,916	2,932	各種金融
PI INDUSTRIES LTD	—	10.67	3,152	4,823	素材
BAJAJ FINANCE LTD	18.4	36.47	25,185	38,533	各種金融
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	—	6.27	4,231	6,473	ソフトウェア・サービス
ADANI GREEN ENERGY LTD	—	51.36	6,947	10,630	公益事業
INDRAPRASTHA GAS LTD	21.6	41.21	1,981	3,032	公益事業
TRENT LTD	—	20.23	2,077	3,177	小売
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	5.22	7.18	1,801	2,755	各種金融
BANDHAN BANK LTD	74.1	100.02	2,689	4,114	銀行
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5.9	14.62	5,158	7,892	食品・飲料・タバコ
EICHER MOTORS LTD	14.79	18.26	4,406	6,742	自動車・自動車部品
BERGER PAINTS INDIA LTD	20.04	27.09	2,005	3,068	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD	15.9	21.84	10,206	15,616	食品・生活必需品小売り
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	18.78	29.89	4,286	6,559	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	6.76	12.71	2,407	3,684	運輸
ADANI TOTAL GAS LTD	—	40.19	6,348	9,713	公益事業
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	—	62.81	3,405	5,210	各種金融
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	—	27.87	2,611	3,995	各種金融
ADANI TRANSMISSION LTD	—	40.01	7,578	11,595	公益事業
TATA STEEL LTD	31.37	93.84	10,460	16,005	素材
CIPLA LTD	31.1	65.26	6,297	9,635	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXIS BANK LTD	231.55	305.68	19,902	30,451	銀行
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12.71	18.33	13,105	20,050	自動車・自動車部品
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	5.73	13.65	1,972	3,018	家庭用品・パーソナル用品
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	236.17	340.64	4,908	7,510	エネルギー
ACC LTD	—	10.19	2,333	3,569	素材
AMBUJA CEMENTS LTD	68.33	93.73	3,460	5,293	素材
ITC LTD	301.71	417.84	9,255	14,160	食品・飲料・タバコ

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	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	
DLF LTD	49.86	85.19	3,193	4,885	不動産
ASIAN PAINTS LTD	30.66	51.75	16,271	24,895	素材
NESTLE INDIA LTD	2.37	4.52	8,588	13,139	食品・飲料・タバコ
HINDUSTAN UNILEVER LTD	84.09	109.78	25,572	39,125	家庭用品・パーソナル用品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	74.13	74.13	2,197	3,362	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	182.52	228.5	10,627	16,260	銀行
ICICI BANK LTD	521.65	680.18	48,864	74,762	銀行
RELIANCE INDUSTRIES LTD	292.86	380.5	92,899	142,135	エネルギー
SIEMENS LTD	6.17	11.67	2,489	3,809	資本財
NTPC LTD	266.78	690.36	8,733	13,361	公益事業
UNITED SPIRITS LTD	29.72	39.2	3,489	5,338	食品・飲料・タバコ
JSW STEEL LTD	95.21	113.53	7,102	10,866	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	200.48	447.52	8,961	13,711	公益事業
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	16.04	38.01	2,273	3,479	運輸
TITAN CO LTD	33.96	46.25	10,749	16,446	耐久消費財・アパレル
BAJAJ FINSERV LTD	3.91	4.87	8,225	12,585	各種金融
BAJAJ AUTO LTD	6.57	9.49	3,129	4,788	自動車・自動車部品
BHARTI AIRTEL LTD	129.29	330.9	24,465	37,431	電気通信サービス
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	72.56	106.59	3,916	5,992	エネルギー
DR. REDDY'S LABORATORIES	12.25	15.14	7,112	10,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GAIL INDIA LTD	138.56	206.78	2,695	4,123	公益事業
GRASIM INDUSTRIES LTD	33.91	33.91	5,710	8,736	素材
HCL TECHNOLOGIES LTD	110.99	146.4	16,589	25,381	ソフトウェア・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	168.25	231.02	62,694	95,922	銀行
HERO MOTOCORP LTD	9.12	16.17	4,027	6,162	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	132.29	212.1	8,911	13,634	素材
LARSEN & TOUBRO LTD	51.37	92.15	16,285	24,916	資本財
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	80.25	117.37	9,985	15,278	自動車・自動車部品
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	90.53	109.32	8,210	12,562	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	92.09	124.72	43,676	66,825	ソフトウェア・サービス
TATA MOTORS LTD	191.34	219.98	10,150	15,530	自動車・自動車部品
WIPRO LTD	116.85	183.4	11,565	17,694	ソフトウェア・サービス
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	88.39	—	—	—	メディア・娯楽
MARICO LTD	46.21	65.77	3,517	5,381	家庭用品・パーソナル用品
ULTRATECH CEMENT LTD	12.4	14.18	10,476	16,029	素材
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	—	74.81	15,108	23,116	銀行
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	—	13.57	7,772	11,891	ヘルスケア機器・サービス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	41.81	48.27	4,408	6,744	家庭用品・パーソナル用品
LUPIN LTD	20.78	31.51	2,813	4,305	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	74.42	170.36	3,646	5,579	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	7.85	25.6	3,592	5,496	各種金融
UPL LTD	55.79	72.08	4,968	7,602	素材
DABUR INDIA LTD	54.21	83.43	4,989	7,633	家庭用品・パーソナル用品

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
REC LTD	53.74	99.15	1,278	1,955	各種金融	
ADANI ENTERPRISES LTD	—	40.24	6,700	10,251	資本財	
COAL INDIA LTD	126.03	207.79	3,205	4,903	エネルギー	
INDUS TOWERS LTD	33.87	96.51	2,716	4,156	電気通信サービス	
小計	6,304.77	11,144.03	930,260	1,423,299		
	84銘柄	101銘柄	—	< 8.1% >		
(インドネシア)			千インドネシア・ルピア			
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	132	132	138,930	1,111	素材	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	212	212	188,150	1,505	食品・飲料・タバコ	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	—	1,189	366,212	2,929	電気通信サービス	
HM SAMPOERNA TBK PT	791	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	791	1,045	483,835	3,870	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED TRACTORS TBK PT	193	193	421,222	3,369	エネルギー	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,162	2,556	1,527,210	12,217	自動車・自動車部品	
GUDANG GARAM TBK PT	40	40	131,100	1,048	食品・飲料・タバコ	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	289	435	356,700	2,853	素材	
KALBE FARMA TBK PT	2,461	2,461	394,990	3,159	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	834	1,129	643,530	5,148	食品・飲料・タバコ	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	513	513	333,450	2,667	食品・飲料・タバコ	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,186	6,927	2,867,778	22,942	電気通信サービス	
ACE HARDWARE INDONESIA	669	—	—	—	小売	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	763	1,037	720,715	5,765	銀行	
ANEKA TAMBANG TBK	—	1,280	298,240	2,385	素材	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,008	7,480	5,535,200	44,281	銀行	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,909	2,656	1,905,680	15,245	銀行	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	656	—	—	—	公益事業	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	5,676	9,130	3,807,210	30,457	銀行	
ADARO ENERGY TBK PT	1,159	2,639	445,991	3,567	エネルギー	
PT XL AXIATA TBK	354	—	—	—	電気通信サービス	
BARITO PACIFIC TBK PT	2,082	3,642	358,737	2,869	素材	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	297	297	231,660	1,853	素材	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	—	2,839	337,841	2,702	電気通信サービス	
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	—	1,797	672,078	5,376	素材	
小計	28,177	49,629	22,166,460	177,331		
	22銘柄	22銘柄	—	< 1.0% >		
(ブラジル)			千ブラジル・レアル			
AMBEV SA	483	654	1,068	21,681	食品・飲料・タバコ	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	64	86	184	3,733	保険	
WEG SA	88.3	224.6	727	14,768	資本財	
COGNA EDUCACAO	141	—	—	—	消費者サービス	
ATACADA0 SA	31	81	125	2,553	食品・生活必需品小売り	
VIBRA ENERGIA SA	86	156.8	339	6,890	小売	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	115	170	193	3,935	ヘルスケア機器・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	
MAGAZINE LUIZA SA	308	410	329	6,687	小売
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	49	67	429	8,706	ヘルスケア機器・サービス
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	13	—	—	—	食品・生活必需品小売り
BANCO BRADESCO S. A.	136.08	179.38	312	6,347	銀行
SUZANO SA	77.15	106.15	590	11,989	素材
ALPARGATAS SA - PREF	—	21	83	1,688	耐久消費財・アパレル
LOCALIZA RENT A CAR	66	79	412	8,374	運輸
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75	106	150	3,051	エネルギー
TOTVS SA	—	66	212	4,303	ソフトウェア・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	84	112	255	5,176	公益事業
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	24	—	—	—	不動産
TELEFONICA BRASIL S. A.	41	69	347	7,044	電気通信サービス
VIA S/A	140	140	81	1,661	小売
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	25.5	25.5	99	2,010	公益事業
NATURA &CO HOLDING SA	91	121	325	6,596	家庭用品・パーソナル用品
TIM SA	72	111	154	3,128	電気通信サービス
RUMO SA	118	156	274	5,576	運輸
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	98	—	—	—	保険
REDE D'OR SAO LUIZ SA	—	54	276	5,614	ヘルスケア機器・サービス
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	487	638	1,880	38,146	エネルギー
BANCO BRADESCO SA-PREF	453.42	658.06	1,333	27,062	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	71	85	191	3,887	素材
VALE SA	378	531	3,690	74,873	素材
GERDAU SA-PREF	111	164	423	8,584	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	381	498	1,501	30,472	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	78.08	139.46	187	3,805	公益事業
ITAUSA SA	451.8	623.8	612	12,428	銀行
BRASKEM SA-PREF A	18	26	135	2,753	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	31	31	100	2,030	公益事業
BRADESPAR SA -PREF	—	32.75	161	3,269	素材
BANCO DO BRASIL S. A.	88	106	326	6,625	銀行
COSAN SA	16	126.88	272	5,529	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	38	38	125	2,538	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	11	110	67	1,361	公益事業
CCR SA	138	138	158	3,222	運輸
BRF SA	59	99	201	4,097	食品・飲料・タバコ
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	39	39	133	2,713	公益事業
CPFL ENERGIA SA	24	24	63	1,283	公益事業
LOJAS RENNEN S. A.	81.8	140.58	406	8,254	小売
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	99	—	—	—	小売
JBS SA	112	118	409	8,314	食品・飲料・タバコ
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	211	820	943	19,132	各種金融
PORTO SEGURO SA	6	—	—	—	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	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	
CIELO SA		93	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HYPERA SA		39	60	164	3,329	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RAIA DROGASIL SA		110	143	323	6,559	食品・生活必需品小売り
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF		496	649	1,470	29,836	銀行
AMERICANAS SA		22.61	52.75	165	3,365	小売
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	6,569.74	9,286.71	22,426	454,999	
(チェコ)				千チェコ・コルナ		
MONETA MONEY BANK AS		65.9	47.9	455	2,284	銀行
CEZ AS		16.5	20.68	1,510	7,585	公益事業
KOMERCNI BANKA AS		7.07	9.34	803	4,035	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	89.47	77.92	2,769	13,905	
(韓国)				千韓国・ウォン		
HANMI PHARM CO LTD		0.55	0.87	22,707	2,175	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUHAN CORP		4.79	7.6	44,764	4,288	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CJ LOGISTICS		0.74	0.74	9,546	914	運輸
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO		6.11	9.63	37,171	3,561	自動車・自動車部品
DL HOLDINGS CO LTD		2.55	—	—	—	資本財
KIA CORP		27.88	35.28	279,417	26,768	自動車・自動車部品
GS RETAIL CO LTD		2.9	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NETMARBLE CORP		2.11	3.37	40,440	3,874	メディア・娯楽
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL		1.14	5.7	30,837	2,954	資本財
DOUZONE BIZON CO LTD		1.9	1.9	14,345	1,374	ソフトウェア・サービス
SK IE TECHNOLOGY CO LTD		—	1.91	31,610	3,028	素材
SK HYNIX INC		56.33	73.1	847,960	81,234	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST		9.21	9.21	41,997	4,023	資本財
SAMSUNG FIRE & MARINE INS		3.15	3.78	78,624	7,532	保険
KAKAOBANK CORP		—	7	49,210	4,714	銀行
ECOPRO BM CO LTD		—	1.47	77,013	7,377	資本財
SK BIOSCIENCE CO LTD		—	2.56	70,912	6,793	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SK SQUARE CO LTD		—	2.27	17,252	1,652	各種金融
CJ CORP		1.68	1.68	13,893	1,331	資本財
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO		6.48	—	—	—	保険
AMOREPACIFIC GROUP		2.4	4.73	20,457	1,959	家庭用品・パーソナル用品
POSCO CHEMICAL CO LTD		2.01	4.61	71,455	6,845	素材
SHINSEGAE INC		0.63	1.2	25,860	2,477	小売
LOTTE CORP		3.01	—	—	—	資本財
HYUNDAI MOTOR CO		15.54	18.61	373,130	35,745	自動車・自動車部品
POSCO		7.79	10	264,500	25,339	素材
NH INVESTMENT & SECURITIES C		7.48	23.76	30,056	2,879	各種金融
GREEN CROSS CORP		—	0.79	17,617	1,687	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GS ENGINEERING & CONSTRUCT		5.12	8.91	33,546	3,213	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	
SAMSUNG SDI CO LTD	5.63	7.37	522,533	50,058	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	28.73	44.96	39,834	3,816	各種金融
OTTOGI CORPORATION	0.04	—	—	—	食品・飲料・タバコ
MERITZ SECURITIES CO LTD	15.8	55.28	28,026	2,684	各種金融
HOTEL SHILLA CO LTD	2.58	4.07	29,385	2,815	小売
HANWHA CORPORATION	5.75	—	—	—	資本財
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5.73	7.94	134,980	12,931	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	3.61	4.78	43,498	4,167	資本財
KOREA ZINC CO LTD	0.97	0.97	48,791	4,674	素材
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	45.93	66.68	35,073	3,360	資本財
S-OIL CORP	4.22	5.53	46,175	4,423	エネルギー
LG INNOTEK CO LTD	1.15	1.58	46,215	4,427	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LOTTE CHEMICAL CORP	1.61	2.07	41,503	3,976	素材
HMM CO LTD	—	36.18	89,545	8,578	運輸
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	2.27	2.27	35,639	3,414	素材
SKC CO LTD	—	2.81	55,919	5,357	素材
HYUNDAI MOBIS CO LTD	6.99	8.97	203,619	19,506	自動車・自動車部品
S-1 CORPORATION	2.19	2.19	16,337	1,565	商業・専門サービス
E-MART INC	1.71	2.37	35,431	3,394	食品・生活必需品小売り
HANON SYSTEMS	15.87	23.8	31,416	3,009	自動車・自動車部品
COWAY CO LTD	5.38	7.46	53,264	5,102	耐久消費財・アパレル
LOTTE SHOPPING CO	0.6	1.72	15,239	1,459	小売
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	26.44	40.84	43,903	4,205	銀行
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	12.67	20.75	44,716	4,283	資本財
PAN OCEAN CO LTD	22.12	45.27	24,536	2,350	運輸
SAMSUNG CARD CO	3.1	—	—	—	各種金融
CHEIL WORLDWIDE INC	5.33	11.93	26,544	2,542	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	18.86	31.03	42,666	4,087	電気通信サービス
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	6.56	10.2	63,240	6,058	保険
KT&G CORP	11.93	15.74	130,799	12,530	食品・飲料・タバコ
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	—	35.99	71,620	6,861	資本財
LG DISPLAY CO LTD	23.78	31.01	63,570	6,090	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK INC	3.75	4.53	115,288	11,044	資本財
KANGWON LAND INC	8.45	13.92	31,876	3,053	消費者サービス
NAVER CORP	12.71	16.49	637,338	61,057	メディア・娯楽
KAKAO CORP	5.89	41.6	511,680	49,018	メディア・娯楽
CJ ENM CO LTD	1.44	1.44	20,808	1,993	小売
KOREA GAS CORPORATION	2.65	—	—	—	公益事業
NCSOFT CORP	1.73	2.28	157,092	15,049	メディア・娯楽
LG CORP	10.17	11.17	90,253	8,646	資本財
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	4.15	4.15	9,835	942	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	4.41	—	—	—	資本財
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5.96	10.63	30,508	2,922	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	
BNK FINANCIAL GROUP INC	20.09	—	—	—	銀行
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	0.96	1.3	144,690	13,861	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	4.74	6.14	437,168	41,880	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	0.89	0.89	30,260	2,898	素材
HYUNDAI STEEL CO	10.44	10.44	40,089	3,840	素材
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	1.8	3.13	29,109	2,788	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	4.19	4.19	39,805	3,813	自動車・自動車部品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	46.86	59.22	214,968	20,593	銀行
KB FINANCIAL GROUP INC	40.39	53.28	294,638	28,226	銀行
DB INSURANCE CO LTD	5.07	5.07	27,428	2,627	保険
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	84.14	110.17	724,918	69,447	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KMW CO LTD	2.41	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	0.17	0.17	10,506	1,006	家庭用品・パーソナル用品
HLB INC	4.05	13.14	48,946	4,689	耐久消費財・アパレル
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	3.34	3.34	11,339	1,086	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLTRION PHARM INC	1.7	1.73	21,157	2,026	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMOREPACIFIC CORP-PREF	0.33	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
FILA HOLDINGS CORP	3.58	6.2	21,576	2,066	耐久消費財・アパレル
SEEGENE INC	2.04	4.08	30,600	2,931	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BGF RETAIL CO LTD	0.61	0.61	8,997	861	食品・生活必需品小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2.43	3.73	38,419	3,680	食品・飲料・タバコ
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	—	1.44	20,952	2,007	素材
WOORI FINANCIAL GROUP INC	55.39	66.54	84,505	8,095	銀行
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	—	3.83	36,691	3,515	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG SDS CO LTD	3.56	4.28	63,130	6,047	ソフトウェア・サービス
ALTEOGEN INC	2.08	3.12	21,216	2,032	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG C&T CORP	8.96	10.79	115,992	11,112	資本財
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1.74	2.21	195,364	18,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PEARL ABYSS CORP	0.54	3.99	53,146	5,091	メディア・娯楽
DOOSAN BOBCAT INC	6.64	6.64	24,435	2,340	資本財
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6.97	11.27	93,879	8,993	ヘルスケア機器・サービス
HYBE CO LTD	—	1.82	67,158	6,433	メディア・娯楽
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	488.73	639.41	4,622,934	442,877	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG ELECTRONICS INC	11.34	14.77	176,501	16,908	耐久消費財・アパレル
CELLTRION INC	9.79	12.93	274,762	26,322	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4.27	5.76	45,446	4,353	各種金融
KOREA ELECTRIC POWER CORP	28.21	34.02	73,313	7,023	公益事業
GS HOLDINGS	4.21	6.28	24,240	2,322	エネルギー
KOREAN AIR LINES CO LTD	10.3	23.28	61,808	5,921	運輸
SK TELECOM	4.05	3.52	20,380	1,952	電気通信サービス
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1.53	2.34	35,217	3,373	運輸
HANA FINANCIAL GROUP	30.7	41.9	170,952	16,377	銀行
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6.39	9.82	44,337	4,247	各種金融

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
AMOREPACIFIC CORP	3.29	4.19	69,763	6,683	家庭用品・パーソナル用品	
SK INNOVATION CO LTD	5.92	6.82	139,469	13,361	エネルギー	
CJ CHEILJEDANG CORP	0.85	1.25	46,125	4,418	食品・飲料・タバコ	
HANWHA SOLUTIONS CORP	9.7	14.76	49,519	4,743	素材	
小 計	株 数 銘 柄 数	・ 金 額 〈 比 率 〉	1,465.75 107銘柄	2,102.46 107銘柄	15,018,888 —	1,438,809 〈 8.2%〉
(マレーシア)			千マレーシア・リンギット			
WESTPORTS HOLDINGS BHD	100	100	41	1,100	運輸	
MISC BHD	118	196	130	3,499	運輸	
SIME DARBY PLANTATION BHD	239	239	87	2,361	食品・飲料・タバコ	
PETRONAS DAGANGAN BHD	30	30	59	1,586	エネルギー	
MALAYAN BANKING BHD	402	535	430	11,564	銀行	
GENTING BHD	258	258	118	3,172	消費者サービス	
PUBLIC BANK BERHAD	298	1,963	777	20,873	銀行	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	19	19	32	879	銀行	
SIME DARBY BERHAD	235	471	103	2,782	資本財	
AXIATA GROUP BERHAD	326	326	129	3,483	電気通信サービス	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	50	50	100	2,703	食品・飲料・タバコ	
TOP GLOVE CORP BHD	495	765	244	6,552	ヘルスケア機器・サービス	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	270	348	285	7,671	素材	
GENTING MALAYSIA BHD	266	438	125	3,363	消費者サービス	
TELEKOM MALAYSIA BHD	82	160	86	2,315	電気通信サービス	
IOI CORP BHD	228	318	115	3,108	食品・飲料・タバコ	
AMMB HOLDINGS BHD	170	170	52	1,405	銀行	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	660	926	473	12,705	銀行	
TENAGA NASIONAL BHD	245	331	306	8,230	公益事業	
GAMUDA BHD	133	—	—	—	資本財	
YTL CORP BHD	165.33	—	—	—	公益事業	
GENTING PLANTATIONS BHD	25	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
PPB GROUP BERHAD	60.4	90.4	153	4,126	食品・飲料・タバコ	
HONG LEONG BANK BERHAD	66	101	183	4,935	銀行	
RHB BANK BHD	164	289	152	4,081	銀行	
PETRONAS GAS BHD	89	106	172	4,639	公益事業	
DIGI.COM BHD	287	388	160	4,302	電気通信サービス	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	83	147	85	2,289	運輸	
MAXIS BHD	268	268	118	3,187	電気通信サービス	
HAP SENG CONSOLIDATED	81	81	61	1,663	資本財	
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12	12	28	770	食品・飲料・タバコ	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6	9	120	3,238	食品・飲料・タバコ	
QL RESOURCES BHD	130.5	130.5	58	1,566	食品・飲料・タバコ	
DIALOG GROUP BHD	362	486	124	3,353	エネルギー	
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	12	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	150	150	35	946	ヘルスケア機器・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
SUPERMAX CORP BHD	166	169.68	36	979	ヘルスケア機器・サービス	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	181	231	147	3,969	ヘルスケア機器・サービス	
IHH HEALTHCARE BHD	205	275	181	4,873	ヘルスケア機器・サービス	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	131	392	205	5,505	素材	
小計	7,268.23 銘柄数 <比率>	10,968.58 40銘柄	5,727 —	153,794 <0.9%>		
(南アフリカ)			千南アフリカ・ランド			
GOLD FIELDS LTD	92.96	114.57	1,981	13,970	素材	
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDIN	89.11	—	—	—	保険	
MR PRICE GROUP LTD	20.37	32.42	644	4,546	小売	
PEPKOR HOLDINGS LTD	70.54	—	—	—	小売	
MULTICHOICE GROUP LTD	42.3	50.73	620	4,372	メディア・娯楽	
OLD MUTUAL LTD	527.88	635.04	791	5,578	保険	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	—	48.13	1,053	7,429	素材	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6.27	10.84	1,912	13,483	銀行	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5.97	7.62	1,235	8,711	素材	
SPAR GROUP LIMITED/THE	17.2	25.98	433	3,053	食品・生活必需品小売り	
SIBANYE STILLWATER LTD	244.09	391.5	1,894	13,353	素材	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	59.57	94.57	392	2,765	保険	
BID CORP LTD	36.3	43.94	1,302	9,183	食品・生活必需品小売り	
VODACOM GROUP LTD	69.97	86.66	1,188	8,379	電気通信サービス	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	46.62	67.3	1,314	9,266	食品・生活必需品小売り	
NEDBANK GROUP LTD	28.34	70.81	1,147	8,090	銀行	
BIDVEST GROUP LTD	24.59	36.06	664	4,687	資本財	
STANDARD BANK GROUP LTD	137.65	174.79	2,254	15,895	銀行	
SASOL LTD	61.46	73.12	1,892	13,340	素材	
REMGRO LTD	43.53	65.63	830	5,857	各種金融	
DISCOVERY LTD	44.82	58.36	778	5,486	保険	
EXXARO RESOURCES LTD	18.48	35.3	538	3,793	エネルギー	
KUMBA IRON ORE LTD	4.9	8.36	365	2,575	素材	
SANLAM LTD	166.2	258.96	1,432	10,099	保険	
TIGER BRANDS LTD	16.29	23.04	424	2,995	食品・飲料・タバコ	
FIRSTRAND LTD	501.88	675.93	3,734	26,328	各種金融	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	77.56	128.22	655	4,624	小売	
ABSA GROUP LTD	80.51	97.19	1,282	9,039	銀行	
NASPERS LTD-N SHS	44.71	29.34	7,222	50,915	小売	
MTN GROUP LTD	182.16	227.04	3,619	25,515	電気通信サービス	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	85.3	106.82	2,042	14,401	素材	
NORTHAM PLATINUM LTD	40.14	—	—	—	素材	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	—	15.03	300	2,116	素材	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	43.63	52.33	1,173	8,272	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	61.14	85.44	546	3,851	素材	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	43.75	58.48	1,885	13,294	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	
CLICKS GROUP LTD	27.73	34.08	979	6,902	食品・生活必需品小売り
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	103.59	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NEPI ROCKCASTLE PLC	31.35	58.44	577	4,068	不動産
REINET INVESTMENTS SCA	16.81	16.81	440	3,104	各種金融
小 計	株 数 3,215.67	株 数 3,998.88	外 貨 建 金 額 49,552	邦 貨 換 算 金 額 349,348	
	銘 柄 数 38銘柄	銘 柄 数 36銘柄	—	< 2.0% >	
(タイ)			千タイ・パーツ		
BANGKOK BANK PCL-Foreign REG	59	—	—	—	銀行
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	1,357	—	—	—	銀行
SIAM CEMENT PCL-NVDR	82	108	4,114	13,908	素材
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	—	363	916	3,098	小売
KASIKORNBANK PCL-Foreign	120	—	—	—	銀行
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	366	366	1,033	3,494	消費者サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR	55	—	—	—	銀行
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	142	247	981	3,318	素材
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	87	127	1,568	5,301	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR	1,500	1,500	693	2,342	電気通信サービス
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	122	160	3,376	11,410	電気通信サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	292	292	335	1,135	銀行
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	975	1,277	2,898	9,797	ヘルスケア機器・サービス
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	154	184	2,088	7,058	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	1,211	—	—	—	エネルギー
RATCH GROUP PCL-NVDR	79	79	345	1,168	公益事業
PTT PCL-NVDR	1,196	1,394	5,018	16,962	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	91	150	727	2,458	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	597	811	4,825	16,310	食品・生活必需品小売り
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	457	550	3,286	11,107	運輸
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	252	252	1,341	4,535	不動産
LAND & HOUSES PUB - NVDR	812	1,089	925	3,128	不動産
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	46	—	—	—	電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	396	531	1,306	4,415	食品・飲料・タバコ
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	252	333	1,898	6,415	素材
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	249	144	1,080	3,650	電気通信サービス
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	102	190	650	2,199	食品・生活必需品小売り
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	25	38	644	2,177	公益事業
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	553	744	1,034	3,495	小売
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	—	45	1,989	6,722	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	319	319	631	2,134	食品・飲料・タバコ
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	85	143	775	2,622	各種金融
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	54	54	791	2,673	ヘルスケア機器・サービス
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	906	906	819	2,771	運輸
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	147	208	1,643	5,554	公益事業
BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	724	1,266	1,063	3,594	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		
B GRIMM POWER PCL-NVDR	68	68	273	925	公益事業	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	200	408	1,632	5,516	公益事業	
OSOTSPA PCL-NVDR	70	162	530	1,793	食品・飲料・タバコ	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	180	180	363	1,228	各種金融	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	696	696	293	992	消費者サービス	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	208.91	208.91	689	2,330	小売	
SCG PACKAGING PCL-NVDR	—	172	1,070	3,618	素材	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	63	118	725	2,452	各種金融	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	—	130	422	1,428	ヘルスケア機器・サービス	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	76	76	433	1,464	各種金融	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	58	96	715	2,417	公益事業	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	—	54	615	2,080	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	15,483.91 43銘柄	16,238.91 42銘柄	56,571 —	191,212 < 1.1% >	
(ポーランド)			千ポーランド・ズロチ			
DINO POLSKA SA	5.01	6.51	218	6,000	食品・生活必需品小売り	
MBANK SA	0.79	—	—	—	銀行	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN LPP SA	30.61	42.09	301	8,279	エネルギー	
SANTANDER BANK POLSKA SA	0.12	0.15	184	5,079	耐久消費財・アパレル	
CD PROJEKT SA	3.6	5.65	191	5,246	銀行	
GRUPA LOTOS SA	7.08	10.44	199	5,491	メディア・娯楽	
PGE SA	9.41	—	—	—	エネルギー	
CYFROWY POLSAT SA	70.7	100.7	81	2,230	公益事業	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	33.8	33.8	115	3,160	メディア・娯楽	
PKO BANK POLSKI SA	15.23	18.13	243	6,699	素材	
BANK PEKAO SA	89.47	118.01	495	13,606	銀行	
POWSZECZNY ZAKLAD UBEZPIECZE	18.79	22.79	264	7,260	銀行	
ORANGE POLSKA SA	61.81	87.49	307	8,458	保険	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	67.1	67.1	56	1,539	電気通信サービス	
ALLEGRO. EU SA	177.26	212.26	116	3,209	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	616.92 16銘柄	773.52 14銘柄	2,974 —	81,706 < 0.5% >	
(ハンガリー)			千ハンガリー・フォリント			
OTP BANK PLC	22.88	29.83	52,903	18,498	銀行	
RICHTER GEDEON NYRT	10.84	18.03	15,505	5,421	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 PL	35.01	58.18	14,195	4,963	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	68.73 3銘柄	106.04 3銘柄	82,605 —	28,884 < 0.2% >	
(ユーロ…ギリシャ)			千ユーロ			
JUMBO SA	10.55	14.51	17	2,302	小売	
MOTOR OIL (HELLAS) CORINTH REFINERIES SA	5.99	—	—	—	エネルギー	
FF GROUP	1.23	1.23	0	75	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	
ALPHA SERVICES AND HOLDINGS		—	300	31	4,021	銀行
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		25.84	29.86	45	5,808	電気通信サービス
PUBLIC POWER CORP		—	28.11	26	3,393	公益事業
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A		—	350.17	31	4,024	銀行
OPAP SA		19.68	27.76	34	4,395	消費者サービス
小計	株数・金額	63.29	751.64	187	24,022	
	銘柄数〈比率〉	5銘柄	7銘柄	—	<0.1%〉	
ユーロ通貨計	株数・金額	63.29	751.64	187	24,022	
	銘柄数〈比率〉	5銘柄	7銘柄	—	<0.1%〉	
合計	株数・金額	225,855.43	304,880.72	—	9,917,488	
	銘柄数〈比率〉	822銘柄	837銘柄	—	<56.5%〉	

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

※〈〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(2) 外国新株予約権証券

銘柄		期首(前期末)		期末	
		証券数	証券数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(タイ)		証券	証券	千タイ・パーツ	千円
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR-CW24		—	9,060	4	15
小計	証券数・金額	—	9,060	4	15
	銘柄数〈比率〉	—	1銘柄	—	<0.0%〉
合計	証券数・金額	—	9,060	—	15
	銘柄数〈比率〉	—	1銘柄	—	<0.0%〉

※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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(3) 外国投資信託証券

銘柄	柄	期首 (前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評 価 額		組 入 比 率
						外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)						千アメリカ・ドル	千円	%
	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ET	61,356	83,970			3,320	377,736	2.2
	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	605	729			17	2,001	0.0
	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	60,624	86,125			3,836	436,520	2.5
	ISHARES MSCI UAE ETF	35,000	58,146			945	107,597	0.6
	ISHARES MSCI QATAR ETF	30,028	38,065			768	87,405	0.5
	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	—	18,439			637	72,487	0.4
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	187,613 5銘柄	285,474 6銘柄			9,525	1,083,748	6.2
(メキシコ)						千メキシコ・ペソ		
	TRUST FIBRA UNO	36,300	36,300			703	3,693	0.0
	CEMEX SAB-CPO	164,400	211,300			2,899	15,228	0.1
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	4,184	4,184			245	1,292	0.0
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	4,500	6,770			706	3,713	0.0
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	27,300	34,100			1,356	7,123	0.0
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	19,900	26,600			4,117	21,629	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	256,584 6銘柄	319,254 6銘柄			10,028	52,681	0.3
(ブラジル)						千ブラジル・リアル		
	ENERGISA SA-UNITS	1,800	1,800			81	1,657	0.0
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	2,300	16,000			340	6,898	0.0
	BANCO INTER SA-UNITS	—	4,200			158	3,213	0.0
	GETNET ADQUIRENCIA E SERVICO	—	1,575			5	120	0.0
	SUL AMERICA SA-UNITS-NEW	56	—			—	—	—
	KLABIN SA - UNIT	7,100	8,800			209	4,240	0.0
	SUL AMERICA SA - UNITS	3,000	—			—	—	—
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,200	6,300			212	4,315	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	18,456 6銘柄	38,675 6銘柄			1,007	20,445	0.1
(香港)						千オフショア・人民元		
	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	463,200	691,400			34,168	609,236	3.5
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	463,200 1銘柄	691,400 1銘柄			34,168	609,236	3.5
(南アフリカ)						千南アフリカ・ランド		
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	25,563	42,751			542	3,827	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	25,563 1銘柄	42,751 1銘柄			542	3,827	0.0
合 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	951,416 19銘柄	1,377,554 20銘柄			—	1,769,939	10.1

※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。

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

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別		期	
		買 建 額	売 建 額
外国	M S C I E m g M k t	百万円 5,988	百万円 —

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

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月30日現在)

項 目	期	
	評 価 額	比 率
株 式	千円	%
新 株 予 約 権 証 券	9,917,488	55.3
投 資 信 託 受 益 証 券	15	0.0
投 資 信 託 受 益 証 券	609,236	3.4
投 資 証 券	1,160,702	6.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,261,192	34.9
投 資 信 託 財 産 総 額	17,948,635	100.0

※期末における外貨建資産（12,923,758千円）の投資信託財産総額（17,948,635千円）に対する比率は72.0%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1香港・ドル=14.59円、1台湾・ドル=4.094円、1エジプト・ポンド=7.24円、1トルコ・リラ=8.926円、1メキシコ・ペソ=5.252円、1フィリピン・ペソ=2.258円、100チリ・ペソ=13.505円、100コロンビア・ペソ=2.82円、1インド・ルピー=1.53円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1ブラジル・レアル=20.288円、1チェコ・コルナ=5.021円、100韓国・ウォン=9.58円、1オフショア・人民元=17.83円、1マレーシア・リンギット=26.851円、1南アフリカ・ランド=7.05円、1タイ・バーツ=3.38円、1ポーランド・ズロチ=27.465円、100ハンガリー・フォリント=34.967円、1ユーロ=128.41円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	29,253,458,643円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,064,361,894
株 式 (評価額)	9,917,488,534
新株予約権証券 (評価額)	15,618
投資信託受益証券 (評価額)	609,236,472
投 資 証 券 (評価額)	1,160,702,755
未 収 入 金	11,400,493,047
未 収 配 当 金	6,023,917
差 入 委 託 証 拠 金	1,095,136,406
(B) 負 債	11,704,821,422
未 払 金	11,704,802,222
そ の 他 未 払 費 用	19,220
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	17,548,637,221
元 本	10,481,267,749
次 期 繰 越 損 益 金	7,067,369,472
(D) 受 益 権 総 口 数	10,481,267,749口
1万口当たり基準価額 (C/D)	16,743円

※当期における期首元本額7,247,902,983円、期中追加設定元本額5,311,760,117円、期中一部解約元本額2,078,395,351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	5,579,019,461円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,537,014,239円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	281,123,454円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	347,001,173円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	231,807,511円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	25,823,557円
三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型)	75,281,661円
三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型)	55,223,465円
三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型)	223,853,475円
三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型)	174,716,658円
三井住友・資産最適化ファンド (5成長重視型)	286,040,332円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	64,850,516円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,488,528円
日興FWS・新興国株インデックス (為替ヘッジあり)	188,448,982円
日興FWS・新興国株インデックス (為替ヘッジなし)	358,795,181円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	1,807,891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>	46,971,665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2020年12月1日 至2021年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	226,701,067円
受 取 配 当 金	228,319,965
受 取 利 息	2,314
支 払 利 息	△ 1,621,212
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	876,274,357
売 買 益	2,533,906,150
売 買 損	△1,657,631,793
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 275,651,509
取 引 益	355,807,148
取 引 損	△ 631,458,657
(D) そ の 他 費 用 等	△ 15,538,125
(E) 当 期 損 益 金 (A+B+C+D)	811,785,790
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	3,807,008,044
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,398,805,971
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,847,381,609
(I) 合 計 (E+F+G+H)	7,067,369,472
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	7,067,369,472

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

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

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

リート・インデックス・マザーファンド

第35期（2022年2月26日から2022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。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) 東証REIT指数 (配当込み)		REIT指数 先物比率 (買建-売建)	投資信託 比率	純資産額
	円	騰落率	東証REIT指数 (配当込み)	騰落率			
31期 (2020年8月25日)	21,827	△19.6	3,707.66	△19.7	0.8	98.4	百万円 6,848
32期 (2021年2月25日)	25,508	16.9	4,330.11	16.8	0.8	97.9	7,697
33期 (2021年8月25日)	27,121	6.3	4,601.21	6.3	0.6	98.9	7,535
34期 (2022年2月25日)	24,907	△8.2	4,210.46	△8.5	0.5	98.3	8,187
35期 (2022年8月25日)	27,322	9.7	4,623.32	9.8	0.4	99.1	9,741

※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

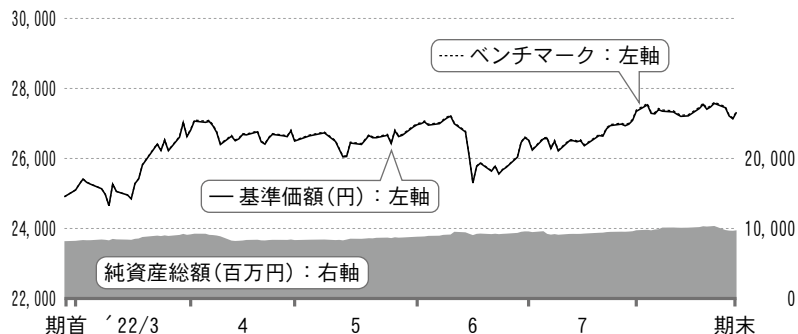
年月日	基準価額		(ベンチマーク) 東証REIT指数 (配当込み)		REIT指数 先物比率 (買建-売建)	投資信託 比率
	円	騰落率	東証REIT指数 (配当込み)	騰落率		
(期首) 2022年2月25日	24,907	—	4,210.46	—	0.5	98.3
2月末	25,098	0.8	4,243.65	0.8	0.5	98.4
3月末	26,810	7.6	4,536.64	7.7	0.4	98.5
4月末	26,498	6.4	4,483.12	6.5	0.5	98.6
5月末	26,966	8.3	4,563.32	8.4	0.5	99.0
6月末	26,525	6.5	4,487.40	6.6	0.4	98.8
7月末	27,346	9.8	4,628.79	9.9	0.4	98.8
(期末) 2022年8月25日	27,322	9.7	4,623.32	9.8	0.4	99.1

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

基準価額等の推移



期首	24,907円
期末	27,322円
騰落率	+9.7%

※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。

※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（2022年2月26日から2022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 ・ 日銀から金融緩和政策を維持する姿勢が示されたこと

▶ 投資環境について（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

Ｊリート市場は上昇しました。

期初から3月中旬にかけては、新型コロナウイルスのオミクロン型の感染拡大やウクライナ情勢の緊迫化などを受け、上値の重い展開となりました。その後、ウクライナ情勢に対する過度な警戒感の緩和や、米国の金融政策イベント通過により投資家心理が持ち直し、国内では日銀の金融緩和政策の維持が示されたことで、上昇しました。

6月には、日銀の政策変更への警戒と長期金利の上昇圧力によって大きく調整する場面がありました。しかし、金融緩和政策の維持が決定され、長期金利に落ち着きが見られる中、期末にかけて上昇が続きました。

▶ ポートフォリオについて（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

リート組入比率

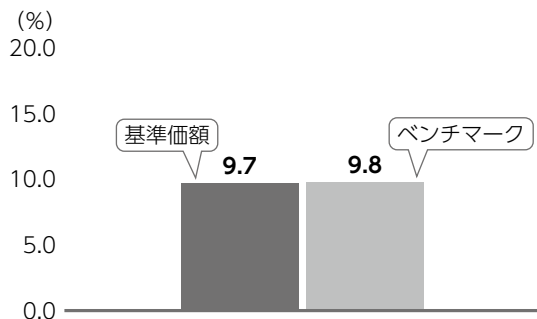
東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、リーートの組入比率は高位を保ちました。

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（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドは、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】

期間における基準価額の騰落率は+9.7%となり、ベンチマークの騰落率+9.8%を0.1%下方乖離しました。

下方乖離要因

・ 売買手数料等のコスト負担が生じたこと

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 (2022年2月26日から2022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 (先物・オプション) (投資信託証券)	6円 (0) (6)	0.021% (0.000) (0.021)	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	0.021	

期中の平均基準価額は26,510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 (2022年2月26日から2022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	49	6,282	32	4,051
	79	7,915	51	5,155
	117	17,985	74	11,354
	58	7,104	14	1,670
	82	54,241	54	35,560
	281	42,146	189	28,395
	407	74,618	229	41,965
	238	84,267	158	55,893
	173	36,837	113	24,249
	124	51,338	87	36,233
	758	130,010	638	112,405
	111	36,833	74	24,493
	390	135,825	259	91,130
	47	29,229	27	17,713
	△ 3 (3)	— (1,831)	— (—)	— (—)
	42	11,652	27	7,585
	279	42,285	246	37,341
	227	36,795	148	24,341
	88	32,854	49	18,194
	726	57,926	481	39,212
	63	8,468	33	4,477

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
		115		32,032		65		18,116
		60		9,731		38		6,354
		43		5,422		10		1,269
		769		127,336		511		83,771
		38		3,519		25		2,247
		291		50,918		192		33,507
		435		24,018		175		10,442
		△ (28 28)		— (1,534)		— (—)		— (—)
		32		4,320		17		2,229
		96		52,024		64		35,356
		35		2,423		24		1,636
		295		14,821		192		9,856
		52		6,702		37		4,761
		101		42,867		48		22,568
		△ 9		—		—		—
		91		18,342		61		12,304
		43		4,922		25		3,146
		△ 4		—		—		—
国内		92		10,742		42		5,023
		89		13,935		61		9,488
		276		191,607		183		124,337
		238		151,403		158		98,847
		1,202		126,125		799		85,268
		475		86,691		315		55,831
		163		65,597		108		43,084
		232		34,799		151		23,019
		159		30,362		106		20,434
		158		17,242		111		12,197
		536		76,621		356		50,623
		171		24,332		115		16,316
		1,056		43,696		705		29,924
		102		53,614		57		29,382
		187		25,945		106		15,893
		△ (10 10)		— (1,379)		— (—)		— (—)
		160		51,167		107		34,144
		123		20,548		82		13,780
		72		49,415		61		43,325

Jリート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	いちごオフィスリート投資法人	201	17,023	131	11,293
	大和証券オフィス投資法人	41	28,523	27	19,160
	阪急阪神リート投資法人	109	16,382	71	10,768
	スタートプロシード投資法人	37	9,050	24	5,802
	大和ハウスリート投資法人	357	113,054	214	68,369
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	876	57,724	493	32,649
	大和証券リビング投資法人	259	30,489	155	18,002
	ジャパンエクセレント投資法人	211	26,773	145	18,817

※金額は受渡し代金。

※（ ）内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

(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 76	百万円 77	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年2月26日から2022年8月25日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(2) 利害関係人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 2

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、当期中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 (2022年2月26日から2022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 (2022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
						千円	%
エスコンジャパンリート投資法人		155	172			20,760	0.2
サンケイリアルエステート投資法人		245	273			27,190	0.3
S O S I L A 物流リート投資法人		361	404			62,781	0.6
東海道リート投資法人		58	102			12,597	0.1
日本アコモデーションファンド投資法人		269	297			201,663	2.1
森ヒルズリート投資法人		919	1,011			155,491	1.6
産業ファンド投資法人		1,108	1,286			233,151	2.4
アドバンス・レジデンス投資法人		780	860			309,170	3.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		558	618			136,454	1.4
アクティビア・プロパティーズ投資法人		416	453			192,978	2.0
GLP投資法人		2,526	2,646			455,376	4.7
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		363	400			134,600	1.4
日本プロロジスリート投資法人		1,277	1,408			489,280	5.0
星野リゾート・リート投資法人		131	151			97,848	1.0
Oneリート投資法人		135	150			41,355	0.4
イオンリート投資法人		919	952			147,750	1.5
ヒューリックリート投資法人		726	805			133,388	1.4
日本リート投資法人		241	280			104,300	1.1
積水ハウス・リート投資法人		2,370	2,615			219,398	2.3
トーセイ・リート投資法人		160	190			26,543	0.3
ケネディクス商業リート投資法人		311	361			101,946	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人		189	211			40,068	0.4
サムティ・レジデンシャル投資法人		186	219			27,594	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人		2,522	2,780			464,538	4.8
いちごホテルリート投資法人		127	140			13,272	0.1
ラサールロジポート投資法人		956	1,055			183,992	1.9
スターアジア不動産投資法人		808	1,068			60,235	0.6
マリモ地方創生リート投資法人		90	105			13,923	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		308	340			184,960	1.9
大江戸温泉リート投資法人		122	133			8,911	0.1
投資法人みらい		946	1,049			53,603	0.6
森トラスト・ホテルリート投資法人		185	200			26,580	0.3
三菱地所物流リート投資法人		213	266			127,414	1.3
三菱物流REIT 新		9	—			—	—
CREロジスティクスファンド投資法人		302	332			69,321	0.7
ザイマックス・リート投資法人		120	138			17,857	0.2
ザイマックス・リート 新		4	—			—	—
タカラレーベン不動産投資法人		308	358			38,878	0.4
アドバンス・ロジスティクス投資法人		305	333			52,214	0.5
日本ビルファンド投資法人		910	1,003			691,067	7.1
ジャパンリアルエステイト投資法人		780	860			548,680	5.6
日本都市ファンド投資法人		3,935	4,338			477,613	4.9
オリックス不動産投資法人		1,553	1,713			331,465	3.4

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
日本プライムリアルティ投資法人			533		588	236,964	2.4
N T T都市開発リート投資法人			748		829	123,023	1.3
東急リアル・エステート投資法人			524		577	113,149	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人			544		591	65,364	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人			1,756		1,936	284,979	2.9
森トラスト総合リート投資法人			560		616	88,457	0.9
インヴィンシブル投資法人			3,439		3,790	162,401	1.7
フロンティア不動産投資法人			274		319	169,070	1.7
平和不動産リート投資法人			508		589	92,060	0.9
日本ロジスティクスファンド投資法人			527		580	189,950	1.9
福岡リート投資法人			404		445	75,561	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人			241		252	179,928	1.8
いちごオフィスリート投資法人			639		709	60,548	0.6
大和証券オフィス投資法人			165		179	126,374	1.3
阪急阪神リート投資法人			352		390	60,450	0.6
スターツプロシード投資法人			121		134	33,768	0.3
大和ハウスリート投資法人			1,171		1,314	423,765	4.4
ジャパン・ホテル・リート投資法人			2,394		2,777	192,168	2.0
大和証券リビング投資法人			1,057		1,161	141,990	1.5
ジャパンエクセレント投資法人			725		791	102,197	1.0
合 計		口	数	金 額			
		銘	柄 数	<比 率>			
			45,588	63銘柄	50,642	61銘柄	99.1
					9,658,386	<99.1%>	

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※外国籍の投資信託証券を含む場合があります。

※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。

※期末時点の保有銘柄のうち、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、ラサールロジポート投資法人、いちごホテルリート投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、星野リゾート・リート投資法人、日本プロロジスリート投資法人、G L P投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、インヴィンシブル投資法人、大和証券リビング投資法人、大和ハウスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、福岡リート投資法人、フロンティア不動産投資法人、日本ビルファンド投資法人につきましては、委託会社の利害関係人等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います。

(当該投資法人で開示されている直近の有価証券報告書等より記載)

(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			百万円		百万円
				40		—

■ 投資信託財産の構成

(2022年8月25日現在)

項 目	期		末	
	評 価 額	比 率		
投 資 証 券	9,658,386	98.7	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	130,304	1.3		
投 資 信 託 財 産 総 額	9,788,691	100.0		

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年8月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	9,788,599,171円
コール・ローン等	67,599,640
投資証券(評価額)	9,658,386,900
未 収 入 金	367,600
未 収 配 当 金	59,947,031
差 入 委 託 証 拠 金	2,298,000
(B) 負 債	47,236,484
未 払 金	43,601,089
未 払 解 約 金	3,635,077
その他未払費用	318
(C) 純資産総額(A-B)	9,741,362,687
元 本	3,565,452,121
次 期 繰 越 損 益 金	6,175,910,566
(D) 受 益 権 総 口 数	3,565,452,121口
1万円当たり基準価額(C/D)	27,322円

※当期における期首元本額3,287,096,881円、期中追加設定元本額1,026,573,165円、期中一部解約元本額748,217,925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)	69,933,114円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	138,890,778円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	107,176,523円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,119,107,775円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,231,438円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	57,002,092円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	41,895,518円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	143,540,085円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	82,933,719円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	65,470,159円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	27,622,937円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,900,184円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	80,474,313円
日興FWS・Jリートインデックス	256,734,387円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	18,173,550円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,541,115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>	60,167,692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>	57,271,336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>	73,878,922円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド2021-05(リスク3%)<適格機関投資家限定>	144,506,484円

※上記表中の受益権総口数および1万円当たり基準価額が、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2022年2月26日 至2022年8月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	114,505,955円
受 取 配 当 金	114,518,963
受 取 利 息	234
そ の 他 収 益 金	10
支 払 利 息	△ 13,252
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	695,444,834
売 買 益	705,118,677
売 買 損	△ 9,673,843
(C) 先 物 取 引 等 損 益	3,582,400
取 引 益	3,582,400
(D) そ の 他 費 用 等	△ 1,497
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	813,531,692
(F) 前期繰越損益金	4,900,034,517
(G) 解約差損益金	△1,254,171,361
(H) 追加信託差損益金	1,716,515,718
(I) 合 計(E+F+G+H)	6,175,910,566
次 期 繰 越 損 益 金(I)	6,175,910,566

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

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

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

■ 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35期（2022年2月26日から2022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。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、 円換算ベース)		投証比 資産信託 比率	純資産 総額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
31期（2020年8月25日）	円 18,760	% △22.6	209.38	% △22.5	% 99.1	百万円 7,606
32期（2021年2月25日）	21,787	16.1	243.93	16.5	99.1	10,232
33期（2021年8月25日）	26,128	19.9	293.88	20.5	99.3	15,061
34期（2022年2月25日）	27,214	4.2	305.61	4.0	99.1	18,859
35期（2022年8月25日）	30,120	10.7	339.05	10.9	98.8	24,967

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

※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

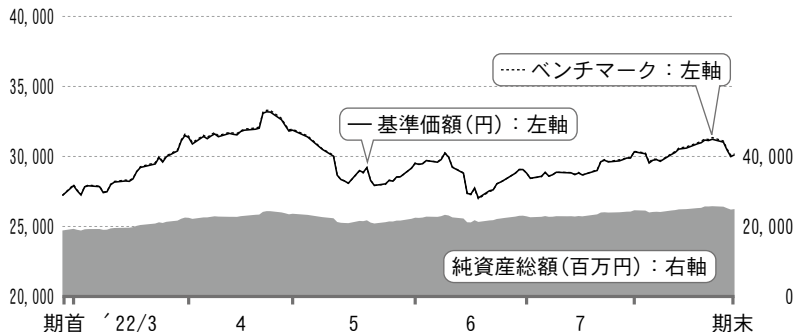
年月日	基準価額		(ベンチマーク) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、 円換算ベース)		投証比 資産信託 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2022年2月25日	円 27,214	% —	305.61	% —	% 99.1
2月末	27,917	2.6	314.34	2.9	99.2
3月末	31,351	15.2	353.16	15.6	97.5
4月末	31,880	17.1	358.74	17.4	97.8
5月末	29,507	8.4	331.73	8.5	98.7
6月末	28,812	5.9	323.71	5.9	97.8
7月末	30,335	11.5	341.00	11.6	98.6
(期末) 2022年8月25日	30,120	10.7	339.05	10.9	98.8

※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（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

基準価額等の推移



期首	27,214円
期末	30,120円
騰落率	+10.7%

※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（2022年2月26日から2022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。

上昇要因	・投資対象通貨が総じて対円で上昇したこと
下落要因	・欧米を中心とした金融引き締め強化の中、長期金利が上昇したこと ・エネルギーや食品価格が上昇し、世界的にインフレ圧力が高まったこと

▶ 投資環境について（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

期間におけるグローバルリート市場は下落しました。為替市場では、米ドルは対円で上昇しました。

グローバルリート市場

期初にロシア・ウクライナ間の停戦協議進展観測を受けて上昇する局面がありましたが、4月から6月にかけて下落しました。特に、米国で上昇の続くインフレ率を抑制するためにFRB（米連邦準備制度理事会）が金融引き締めを強化する中、長期金利が上昇したことや、欧州においてもECB（欧州中央銀行）による利上げ観測が高まったこと（7月に利上げを実施）が、下落の要因となりました。

期末にかけては米国の長期金利が下落に転じたことが追い風となり、堅調に推移しました。

為替市場

期末の米ドル・円は、期初と比較して円安となりました。米国では利上げが進み金利が上昇した一方、日本では低金利政策が維持され国内金利の上昇が抑制されたことから、日米金利差が意識され、期を通じて米ドル高・円安となりました。

▶ ポートフォリオについて（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

ポートフォリオの特性

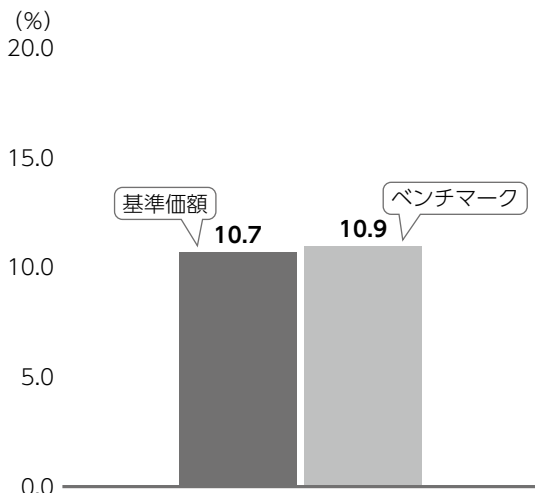
S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

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（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドは、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+10.7%となり、ベンチマークの騰落率+10.9%を0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コスト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 (2022年2月26日から2022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 (株式) (投資信託証券)	6円 (0) (6)	0.022% (0.002) (0.020)	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 (0) (3)	0.009 (0.000) (0.009)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	14 (8) (6)	0.047 (0.028) (0.019)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	23	0.077	

期中の平均基準価額は29,616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 (2022年2月26日から2022年8月25日まで)

(1) 株式

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
外国	百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
アメリカ	72.68	44	615.32	367

※金額は受渡し代金。

(2) 投資信託証券

	買付		売付	
	口数	買付額	口数	売付額
外国	口	千アメリカ・ドル	口	千アメリカ・ドル
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	2,450	49	—
	LXP INDUSTRIAL TRUST	7,988	98	—
	AGREE REALTY CORP	2,527	168	—
	EASTGROUP PROPERTIES INC	838	132	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,071	673	183
	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,404	844	—
	BOSTON PROPERTIES INC	3,000	316	—
	VORNADO REALTY TRUST	5,131	173	—
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	8,434 (17,535)	238 (—)	— (—)
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,965	191	—
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	3,879	158	—
	URBAN EDGE PROPERTIES	3,911	72	—
PARAMOUNT GROUP INC	5,556	60	—	

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
EQUITY RESIDENTIAL	7,511	609	—	—
EPR PROPERTIES	1,626	85	—	—
EQUINIX INC	2,232	1,525	71	53
SUN COMMUNITIES INC	3,438	565	87	15
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	7,511	359	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	14,143	271	—	—
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	9,085	347	—	—
REALTY INCOME CORP	18,430	1,269	978	70
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	3,823	69	—	—
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,236	72	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,681	496	—	—
TERRENO REALTY CORP	2,155	136	—	—
SABRA HEALTH CARE REIT INC	5,345	74	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4,496	199	—	—
INVITATION HOMES INC	15,235	570	—	—
XENIA HOTELS & RESORTS INC	3,457	60	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	7,834	139	—	—
CYRUSONE INC	601 (△ 13,766)	54 (△ 1,240)	— (—)	— (—)
PARK HOTELS & RESORTS INC	8,048	135	—	—
STORE CAPITAL CORP	5,668	150	—	—
APPLE HOSPITALITY REIT INC	4,730	76	—	—
JBG SMITH PROPERTIES	2,929	71	—	—
RLJ LODGING TRUST	2,948	36	—	—
PENN REAL ESTATE INVEST TST	— (△ 5,040)	— (—)	— (—)	— (—)
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	— (△ 9,490)	— (△ 199)	— (—)	— (—)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1,712	44	—	—
VICI PROPERTIES INC	56,226	1,677	—	—
PS BUSINESS PARKS INC/MD	584 (△ 2,617)	104 (△ 424)	— (—)	— (—)
COUSINS PROPERTIES INC	3,912	130	—	—
AMERICOLD REALTY TRUST INC	5,714	159	—	—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	6,167	412	—	—
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,414	129	—	—
RETAIL VALUE INC	—	—	2,032	5
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	5,191	122	—	—
KIMCO REALTY CORP	12,921	293	—	—
APARTMENT INCOME REIT CO	2,651	128	—	—
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	3,482	180	—	—
STAG INDUSTRIAL INC	4,305	149	—	—
CARETRUST REIT INC	3,957	68	—	—
BROADSTONE NET LEASE INC	7,430	159	—	—
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	12,336	409	—	—
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,406	245	—	—

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	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648	103	—	—
	LIFE STORAGE INC	1,857	216	—	—
	VENTAS INC	9,202	504	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	6,791	362	831	46
	PROLOGIS INC	17,496	2,407	624	105
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,551	774	419	85
	VERIS RESIDENTIAL INC	3,000	41	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,116	450	274	47
	SITE CENTERS CORP	7,985	118	—	—
	DUKE REALTY CORP	7,921	455	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,630	485	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,989	224	—	—
	WELLTOWER INC	13,444	1,155	885	85
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	12,168	357	—	—
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,325	129	—	—
	SERVICE PROPERTIES TRUST	8,811	57	559	4
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2,622 (△ 17,535)	72 (—)	— (—)	— (—)
	KILROY REALTY CORP	1,727	113	—	—
	MACERICH CO/THE	8,969	110	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,347	323	—	—
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	2,327	59	—	—
	PUBLIC STORAGE	3,557	1,227	90	36
	REGENCY CENTERS CORP	5,196	344	1,127	77
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4,585	71	—	—
	SL GREEN REALTY CORP	1,019	62	—	—
	UDR INC	8,049	414	—	—
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6,045	186	—	—
	CUBESMART	6,334	292	—	—
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	4,710	46	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	6,326	843	—	—
	CEDAR REALTY TRUST INC	— (△ 2,376)	— (△ 54)	— (—)	— (—)
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,097	579	—	—
	KITE REALTY GROUP TRUST	3,506	60	—	—
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2,446 (△ 17,614)	158 (△ 952)	— (—)	— (—)	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	5,722	54	—	—	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	12,041	203	—	—	
DOUGLAS EMMETT INC	5,415	148	—	—	
ACADIA REALTY TRUST	1,935	37	—	—	
ALEXANDER & BALDWIN INC	1,756	35	—	—	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,586	47	—	—	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3,581	53	—	—	
CHATHAM LODGING TRUST	—	—	1,866	23	
COREPOINT LODGING INC	— (△ 3,610)	— (△ 57)	— (—)	— (—)	
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	CTO REALTY GROWTH INC	— (620)	— (—)	— (—)	— (—)
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	2,100	39	—	—
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	8,461	67	—	—
	EQUITY COMMONWEALTH	2,513	68	—	—
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	9,100	39	—	—
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2,266	47	—	—
	GLADSTONE LAND CORP	1,890	72	—	—
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	17,071	417	—	—
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,348	210	—	—
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,331	129	636	40
	NEXPOINT RESIDENTIAL	1,174	76	—	—
	PREFERRED APARTMENT COMMUNIT	—	—	6,243	155
	SAUL CENTERS INC	1,437	61	—	—
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	—	—	3,468	27
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,377	43	—	—
	WP CAREY INC	4,204	350	—	—
	WASHINGTON REIT	2,822	72	—	—
	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000 (—)	60 (△ 0)	— (—)	— (—)
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	76,900 (—)	55 (△ 1)	— (—)	— (—)
	PRIME US REIT	— (—)	— (△ 0)	— (—)	— (—)
MANULIFE US REAL ESTATE INV	73,900	50	—	—	
カ ナ ダ		□	千カナダ・ドル	□	千カナダ・ドル
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,944	62	—	—
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	4,623	77	—	—
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,270	54	1,927	24
	PRIMARIS REIT	2,212	35	—	—
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	4,325	57	—	—
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	1,010	14	—	—
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	— (△ 12,355)	— (△ 144)	— (—)	— (—)
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	5,488	71	—	—
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4,000	57	—	—
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	387	37	—	—
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,020	67	—	—
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,376	67	—	—
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,478	120	—	—
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,927	66	—	—
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,190	68	—	—
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1,779	59	—	—
オーストラリア		□	千オーストラリア・ドル	□	千オーストラリア・ドル
	SCENTRE GROUP	106,250	296	—	—
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	27,341	81	—	—

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	NATIONAL STORAGE REIT	20,000	42	—	—
	WAYPOINT REIT	37,066	96	—	—
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	30,975	91	—	—
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	10,000	33	—	—
	IRONGATE GROUP	44,630 (△ 87,034)	85 (△ 158)	— (—)	— (—)
	CENTURIA CAPITAL GROUP	40,048	81	—	—
	HOMECA DAILY NEEDS REIT	70,305	100	—	—
	DEXUS/AU	24,170	252	—	—
	HOME CONSORTIUM LTD	17,279	80	—	—
	HEALTHCO REIT	51,410	105	—	—
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	89,106	83	—	—
	BWP TRUST	21,950	89	—	—
	GPT GROUP	31,228	155	—	—
	MIRVAC GROUP	96,196	212	—	—
	STOCKLAND	47,492	192	—	—
	ABACUS PROPERTY GROUP	18,000	47	—	—
	GOODMAN GROUP	42,175	862	3,938	91
	VICINITY CENTRES	80,412	149	—	—
CHARTER HALL GROUP	13,312	186	—	—	
香 港		□	千香港・ドル	□	千香港・ドル
	CHAMPION REIT	62,000	225	—	—
	LINK REIT	51,000	3,417	—	—
	FORTUNE REIT	56,000	369	—	—
シ ン ガ ポ ー ル		□	千シンガポール・ドル	□	千シンガポール・ドル
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC	60,600 (—)	82 (△ 2)	— (—)	— (—)
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	50,300 (—)	130 (△ 0)	— (—)	— (—)
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	— (—)	— (△ 1)	— (—)	— (—)
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	38,400	92	—	—
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	90,400	58	—	—
	KEPPEL DC REIT	27,300 (—)	55 (△ 1)	— (—)	— (—)
	IREIT GLOBAL	— (—)	— (△ 1)	— (—)	— (—)
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	— (△235,000)	— (△ 244)	— (—)	— (—)
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	86,000 (—)	242 (△ 7)	— (—)	— (—)
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERC	121,900 (—)	265 (△ 0)	— (—)	— (—)
	SUNTEC REIT	26,000 (—)	44 (△ 1)	— (—)	— (—)
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	101,200 (—)	184 (△ 5)	— (—)	— (—)
KEPPEL REIT	72,900	86	—	—	

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	ASCOTT RESIDENCE TRUST	54,500 (-)	62 (△ 3)	- (-)	- (-)
	ESR-LOGOS REIT	(207,961)	(△ 11)	(-)	(-)
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	(-)	(△ 0)	(-)	(-)
	CAPITALAND CHINA TRUST	(-)	(△ 3)	(-)	(-)
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	8,400 (-)	41 (△ 0)	(-)	(-)
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	81,900 (-)	156 (△ 1)	(-)	(-)
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	(△117,300)	(△ 0)	(-)	(-)
	AIMS APAC REIT	(-)	(△ 0)	(-)	(-)
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	(-)	(△ 0)	(-)	(-)
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	203,200	161	79,500	62
ニュージーランド	□ キニューゼーランド・ドル	□ キニューゼーランド・ドル	□ キニューゼーランド・ドル	□ キニューゼーランド・ドル	□ キニューゼーランド・ドル
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	53,399	57	-	-
	ARGOSY PROPERTY LTD	23,725	29	-	-
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	11,358	32	-	-
	GOODMAN PROPERTY TRUST	8,932	20	-	-
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	41,326	60	-	-	
イギリス	□ キイギリス・ポンド	□ キイギリス・ポンド	□ キイギリス・ポンド	□ キイギリス・ポンド	□ キイギリス・ポンド
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	45,499	98	-	-
	ASSURA PLC	91,163	61	-	-
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	19,264	53	-	-
	UNITE GROUP PLC/THE	12,671	144	3,498	39
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	4,252	56	-	-
	HOME REIT PLC	30,904	35	-	-
	PRS REIT PLC/THE	47,362	51	-	-
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	29,815	43	-	-
	LAND SECURITIES GROUP PLC	17,077	123	-	-
	SEGro PLC	28,017	314	-	-
	BRITISH LAND CO PLC	19,664	102	-	-
	DERWENT LONDON PLC	3,362	95	-	-
	WORKSPACE GROUP PLC	6,854	44	-	-
	SHAFTESBURY PLC	9,022	56	-	-
	BIG YELLOW GROUP PLC	5,968	87	-	-
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	56,726	45	-	-	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	40,000	52	-	-	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	34,963	34	-	-	
LXI REIT PLC	168,627	238	-	-	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	35,417	49	-	-	
イスラエル	□ キイスラエル・シェケル	□ キイスラエル・シェケル	□ キイスラエル・シェケル	□ キイスラエル・シェケル	□ キイスラエル・シェケル
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	25,500	256	-	-	

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 韓 国		REIT 1 LTD	8,073	170	-	-
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	□ 3,626	千韓国・ウォン 23,748	□ -	千韓国・ウォン -
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	(9,692 -)	(△ 56,722 30)	(-)	(-)
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	(2,023)	(-)	2,023 (-)	(-)
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	(706)	(-)	706 (-)	(-)
		D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350	34,138	-	-
		SK REITS CO LTD	12,831	81,660	-	-
		JR GLOBAL REIT	(2,449)	(-)	2,449 (-)	(-)
		SK REITS CO LTD-RIGHTS	(3,437)	(-)	3,437 (-)	(-)
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	3,460	27,400	-	-
		JR REIT XXVII	6,233	27,726	-	-
	ユ ー ロ ー プ	アイルランド	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	□ 7,207	千ユーロ 10	□ -
HIBERNIA REIT PLC			6,079 (△ 77,486)	9 (△ 90)	-	(-)
オランダ		NSI NV	381	14	-	-
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	(831 63)	(17 -)	(-)	(-)
		WERELDHAVE NV	1,572	22	-	-
ベルギー		MONTEA NV	245	23	-	-
		AEDIFICA	1,188	122	-	-
		COFINIMMO	991	118	86	11
		BEFIMMO	624	29	2,757	130
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,436	120	-	-
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	1,112	29	-	-
		XIOR STUDENT HOUSING NV	457	23	-	-
フランス		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,823	176	-	-
		ICADE	(-)	(△ 3)	(-)	(-)
		GECINA SA	1,297	137	-	-
		KLEPIERRE	(4,338 -)	(△ 85 35)	(-)	(-)
		COVIVIO	1,231	83	-	-
		ALTAREA	218 (-)	33 (△ 3)	96 (-)	13 (-)
	CARMILA	(2,418 -)	(△ 37 4)	(-)	(-)	
ドイツ	HAMBORNER REIT AG	2,978	25	1,562	14	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	280	3	-	-	
スペイン	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	(7,998 -)	(△ 82 8)	(-)	(-)	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	(7,052 -)	(△ 52 5)	(-)	(-)	

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	ユ ー ロ ー プ	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	(-)	(△ - 1)	(-)	(-)
		イ タ リ ア COIMA RES SPA	1,165	9	3,144	31
	そ の 他	CROMWELL REIT EUR	(20,600 -)	(△ 47 1)	(-)	(-)

※金額は受渡し代金。

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

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

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2022年2月26日から2022年8月25日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	55,957千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	-
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	-

※(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 (2022年2月26日から2022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

(2022年2月26日から2022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 (2022年8月25日現在)

(1) 外国株式

銘 柄	株 数	期首(前期末)	期 末		業 種 等
			株 数	評 価 額	
				外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ) DIGITALBRIDGE GROUP INC	百株 542.64	百株 -	千アメリカ・ドル -	千円 -	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 542.64	株 数 -	金 額 -	金 額 -	
	銘 柄 数 <比 率>	1銘柄	-	<->	
合 計	株 数 ・ 金 額 542.64	株 数 -	金 額 -	金 額 -	
	銘 柄 数 <比 率>	1銘柄	-	<->	

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

※<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

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

外国リート・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		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
				千アメリカ・ドル	千円	組入比率	
(シンガポール)		口		口		%	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	—		69,000		54	7,466	0.0
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	54,000		130,900		85	11,654	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000		20,000		2	375	0.0
PRIME US REIT	54,200		54,200		34	4,714	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INV	172,000		245,900		122	16,841	0.1
(アメリカ)							
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15,094		17,544		335	45,900	0.2
LXP INDUSTRIAL TRUST	29,012		37,000		391	53,672	0.2
RPT REALTY	8,262		8,262		83	11,464	0.0
AGREE REALTY CORP	7,050		9,577		745	102,114	0.4
EASTGROUP PROPERTIES INC	4,512		5,350		905	124,070	0.5
AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,039		17,927		3,764	515,610	2.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	35,270		42,674		4,552	623,596	2.5
BOSTON PROPERTIES INC	15,428		18,428		1,523	208,681	0.8
APARTMENT INV & MGMT CO -A	15,893		15,893		147	20,181	0.1
VORNADO REALTY TRUST	16,715		21,846		606	83,100	0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,831		48,800		1,260	172,596	0.7
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	31,235		39,200		880	120,547	0.5
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	13,256		17,135		724	99,214	0.4
URBAN EDGE PROPERTIES	11,117		15,028		244	33,554	0.1
PARAMOUNT GROUP INC	14,599		20,155		145	19,905	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	36,389		43,900		3,367	461,229	1.8
EPR PROPERTIES	7,974		9,600		444	60,832	0.2
EQUINIX INC	9,601		11,762		7,897	1,081,844	4.3
SUN COMMUNITIES INC	12,366		15,717		2,512	344,100	1.4
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	23,563		31,074		1,585	217,124	0.9
HOST HOTELS & RESORTS INC	76,626		90,769		1,697	232,507	0.9
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	29,419		38,504		1,409	193,091	0.8
REALTY INCOME CORP	60,803		78,255		5,527	757,216	3.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289		17,289		237	32,516	0.1
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	12,609		16,432		285	39,142	0.2
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,815		6,051		402	55,144	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,436		15,117		2,675	366,435	1.5
TERRENO REALTY CORP	7,571		9,726		618	84,678	0.3
SABRA HEALTH CARE REIT INC	22,878		28,223		437	59,961	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	18,204		22,700		1,045	143,158	0.6
INVITATION HOMES INC	63,633		78,868		2,971	407,069	1.6
XENIA HOTELS & RESORTS INC	11,870		15,327		262	35,964	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	23,370		31,204		541	74,202	0.3
CYRUSONE INC	13,165		—		—	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC	24,384		32,432		474	64,949	0.3
STORE CAPITAL CORP	26,534		32,202		888	121,744	0.5
APPLE HOSPITALITY REIT INC	21,470		26,200		437	59,898	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	12,389		15,318		352	48,301	0.2

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末
	口数	口数	評価額		組入比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
RLJ LODGING TRUST	17,225	20,173	258	35,397	0.1
PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,400	360	1	273	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	9,490	—	—	—	—
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8,024	9,736	272	37,288	0.1
VICI PROPERTIES INC	68,217	124,443	4,229	579,400	2.3
PS BUSINESS PARKS INC/MD	2,033	—	—	—	—
COUSINS PROPERTIES INC	15,388	19,300	546	74,896	0.3
AMERICOLD REALTY TRUST INC	28,024	33,738	1,031	141,230	0.6
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	15,714	21,881	1,425	195,331	0.8
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5,712	7,126	625	85,683	0.3
RETAIL VALUE INC	2,032	—	—	—	—
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	12,429	17,620	409	56,115	0.2
KIMCO REALTY CORP	67,097	80,018	1,768	242,235	1.0
APARTMENT INCOME REIT CO	17,009	19,660	850	116,527	0.5
GETTY REALTY CORP	5,036	5,036	152	20,860	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	13,518	17,000	891	122,091	0.5
STAG INDUSTRIAL INC	18,095	22,400	727	99,690	0.4
CARETRUST REIT INC	9,346	13,303	288	39,451	0.2
BROADSTONE NET LEASE INC	16,254	23,684	478	65,533	0.3
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165	2,165	39	5,415	0.0
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515	2,515	23	3,234	0.0
INDUS REALTY TRUST INC	823	823	51	7,088	0.0
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424	1,424	22	3,029	0.0
ORION OFFICE REIT INC	5,199	5,199	52	7,164	0.0
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	2,918	15,254	506	69,392	0.3
INVENTRUST PROPERTIES CORP	—	8,406	230	31,561	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	—	3,648	108	14,926	0.1
LIFE STORAGE INC	9,001	10,858	1,459	199,867	0.8
VENTAS INC	43,197	52,399	2,527	346,248	1.4
IRON MOUNTAIN INC	31,628	37,588	2,046	280,352	1.1
PROLOGIS INC	79,064	95,936	12,579	1,723,088	6.9
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,113	19,245	3,066	420,075	1.7
BRANDYWINE REALTY TRUST	20,191	20,191	165	22,679	0.1
VERIS RESIDENTIAL INC	7,798	10,798	149	20,485	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	10,746	13,588	1,857	254,474	1.0
SITE CENTERS CORP	18,028	26,013	359	49,279	0.2
DUKE REALTY CORP	41,226	49,147	3,044	417,057	1.7
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,940	8,570	2,401	329,025	1.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,311	9,300	987	135,289	0.5
WELLTOWER INC	46,568	59,127	4,582	627,770	2.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	56,651	68,819	1,864	255,372	1.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	10,521	13,846	441	60,540	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	17,194	25,446	190	26,072	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	14,913	—	—	—	—
KILROY REALTY CORP	11,327	13,054	657	89,996	0.4
LTC PROPERTIES INC	5,036	5,036	223	30,600	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		
MACERICH CO/THE	21,231	30,200	300	41,202	0.2	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	18,499	22,846	1,671	228,950	0.9	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	11,896	14,223	374	51,278	0.2	
PUBLIC STORAGE	16,267	19,734	6,768	927,212	3.7	
REGENCY CENTERS CORP	16,551	20,620	1,303	178,510	0.7	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	10,751	15,336	248	34,094	0.1	
SL GREEN REALTY CORP	7,052	8,071	371	50,844	0.2	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884	23,884	39	5,398	0.0	
UDR INC	30,627	38,676	1,825	250,057	1.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	24,932	30,977	1,007	137,989	0.6	
CUBESMART	22,914	29,248	1,427	195,592	0.8	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	24,669	29,379	348	47,688	0.2	
DIGITAL REALTY TRUST INC	30,461	36,787	4,621	633,110	2.5	
CEDAR REALTY TRUST INC	2,376	—	—	—	—	
EXTRA SPACE STORAGE INC	14,431	17,528	3,640	498,636	2.0	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,876	2,876	31	4,325	0.0	
KITE REALTY GROUP TRUST	24,850	28,356	576	78,965	0.3	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	15,168	—	—	—	—	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	20,954	26,676	249	34,202	0.1	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	65,190	77,231	1,174	160,908	0.6	
DOUGLAS EMMETT INC	18,117	23,532	481	65,918	0.3	
ACADIA REALTY TRUST	8,247	10,182	169	23,166	0.1	
ALEXANDER & BALDWIN INC	6,758	8,514	163	22,391	0.1	
ALEXANDER'S INC	300	300	74	10,183	0.0	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,414	7,000	199	27,375	0.1	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	17,023	17,023	134	18,421	0.1	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	4,848	8,429	115	15,841	0.1	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,745	3,745	96	13,224	0.1	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400	8,400	47	6,443	0.0	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	2,658	2,658	18	2,552	0.0	
CENTERSPACE	1,542	1,542	121	16,690	0.1	
CHATHAM LODGING TRUST	7,423	5,557	71	9,827	0.0	
CITY OFFICE REIT INC	4,603	4,603	57	7,824	0.0	
CLIPPER REALTY INC	800	800	6	922	0.0	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216	3,216	124	17,083	0.1	
COREPOINT LODGING INC	3,610	—	—	—	—	
CTO REALTY GROWTH INC	310	930	19	2,732	0.0	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	9,769	11,869	218	29,947	0.1	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	12,815	21,276	157	21,537	0.1	
EQUITY COMMONWEALTH	12,245	14,758	396	54,319	0.2	
FARMLAND PARTNERS INC	4,666	4,666	67	9,242	0.0	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	6,015	15,115	45	6,252	0.0	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,102	5,368	106	14,639	0.1	
GLADSTONE LAND CORP	2,574	4,464	107	14,767	0.1	
GLOBAL NET LEASE INC	13,146	13,146	186	25,498	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,669	5,669	64	8,798	0.0	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘 柄	期首(前期末)		期 末		組 入 比 率
	口 数	口 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	10,979	28,050	573	78,574	0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274	6,274	51	7,038	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,474	3,822	370	50,725	0.2
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,500	10,195	556	76,207	0.3
NETSTREIT CORP	4,793	4,793	98	13,544	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,355	3,529	203	27,839	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,071	5,071	94	12,913	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352	2,352	58	8,018	0.0
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,040	14,040	174	23,847	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUNIT	6,243	—	—	—	—
SAFEHOLD INC	1,242	1,242	52	7,223	0.0
SAUL CENTERS INC	894	2,331	108	14,927	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,468	—	—	—	—
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9,721	14,098	120	16,453	0.1
UMH PROPERTIES INC	6,284	6,284	115	15,812	0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344	1,344	70	9,639	0.0
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,927	2,927	51	6,988	0.0
WP CAREY INC	20,296	24,500	2,103	288,147	1.2
WASHINGTON REIT	7,968	10,790	216	29,648	0.1
WHITESTONE REIT	4,511	4,511	47	6,463	0.0
BRT APARTMENTS CORP	500	500	12	1,682	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774	4,774	99	13,582	0.1
小 計	2,608,015	3,362,199	140,694	19,272,330	77.2
	口 数 金 額 銘 柄 数 <比 率>	154銘柄	147銘柄	<77.2%>	
(カナダ)			千カナダ・ドル		
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5,163	8,107	140	14,855	0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447	1,447	22	2,356	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,551	4,551	75	7,993	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	9,177	13,800	258	27,360	0.1
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	13,622	13,622	50	5,358	0.0
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,377	11,377	40	4,318	0.0
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	1,387	1,387	6	736	0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT	2,002	4,345	46	4,879	0.0
PRIMARIS REIT	4,106	6,318	88	9,319	0.0
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,337	9,662	108	11,503	0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	1,715	2,725	35	3,757	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	17,893	17,893	251	26,544	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	12,355	—	—	—	—
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	5,107	5,107	82	8,726	0.0
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	12,411	17,899	216	22,919	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	10,775	14,775	228	24,137	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,176	3,563	275	29,137	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	6,178	11,198	141	14,966	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557	1,557	27	2,889	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12,305	12,305	160	16,953	0.1
SLATE OFFICE REIT	3,663	3,663	16	1,742	0.0

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額		組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196	3,196	46	4,913	0.0	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,770	4,770	29	3,142	0.0	
PLAZA RETAIL REIT	8,509	8,509	36	3,868	0.0	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	7,064	9,440	270	28,588	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,946	11,424	525	55,518	0.2	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	16,425	16,425	215	22,803	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,598	19,525	402	42,530	0.2	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,169	2,169	40	4,320	0.0	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,000	3,190	157	16,656	0.1	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,021	8,800	282	29,850	0.1	
小計	222,002 口数・金額 銘柄数<比率>	252,749 30銘柄	4,280	452,652 <1.8%>	1.8	
(オーストラリア)			千オーストラリア・ドル			
SCENTRE GROUP	553,750	660,000	1,874	177,824	0.7	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	116,511	143,852	386	36,711	0.1	
CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718	158,718	125	11,895	0.0	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	30,439	30,439	106	10,078	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	109,680	129,680	312	29,649	0.1	
WAYPOINT REIT	76,045	113,111	288	27,363	0.1	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	37,955	37,955	140	13,358	0.1	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	53,468	84,443	251	23,873	0.1	
GDI PROPERTY GROUP	43,204	43,204	39	3,729	0.0	
ARENA REIT	45,981	45,981	197	18,713	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	15,921	25,921	85	8,090	0.0	
RURAL FUNDS GROUP	52,739	52,739	134	12,758	0.1	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,965	39,965	186	17,668	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237	30,237	83	7,888	0.0	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,852	73,852	328	31,178	0.1	
IRONGATE GROUP	42,404	—	—	—	—	
CENTURIA OFFICE REIT	43,559	43,559	71	6,735	0.0	
CENTURIA CAPITAL GROUP	64,710	104,758	190	18,087	0.1	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	117,492	187,797	238	22,626	0.1	
DEXUS/AU	112,830	137,000	1,182	112,165	0.4	
HOME CONSORTIUM LTD	16,399	33,678	175	16,646	0.1	
HEALTHCO REIT	—	51,410	90	8,559	0.0	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	—	89,106	74	7,100	0.0	
BWP TRUST	45,015	66,965	267	25,411	0.1	
GPT GROUP	203,413	234,641	976	92,603	0.4	
CHARTER HALL RETAIL REIT	62,449	62,449	256	24,349	0.1	
MIRVAC GROUP	438,177	534,373	1,116	105,954	0.4	
STOCKLAND	249,539	297,031	1,072	101,727	0.4	
ABACUS PROPERTY GROUP	32,980	50,980	137	13,010	0.1	
GOODMAN GROUP	182,852	221,089	4,278	405,860	1.6	
VICINITY CENTRES	398,729	479,141	900	85,457	0.3	
CHARTER HALL GROUP	50,934	64,246	805	76,431	0.3	
小計	3,499,947 口数・金額 銘柄数<比率>	4,328,320 31銘柄	16,375	1,553,511 <6.2%>	6.2	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額	評価額	組入比率	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)			千香港・ドル			
CHAMPION REIT	177,000	239,000	814	14,229		0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	110,000	110,000	407	7,106		0.0
PROSPERITY REIT	178,000	178,000	423	7,396		0.0
LINK REIT	222,900	273,900	16,707	291,719		1.2
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	230,000	230,000	556	9,718		0.0
FORTUNE REIT	152,000	208,000	1,335	23,315		0.1
小計	1,069,900	1,238,900	20,245	353,486		1.4
	口数・金額 銘柄数<比率>	6銘柄		6銘柄		<1.4%>
(シンガポール)			千シンガポール・ドル			
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	309,638	370,238	510	50,270		0.2
SPH REIT	115,700	115,700	108	10,643		0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	193,500	243,800	636	62,607		0.3
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	176,400	176,400	49	4,859		0.0
FRASERS CENTREPOINT TRUST	103,400	141,800	320	31,530		0.1
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	99,600	190,000	117	11,590		0.0
KEPPEL DC REIT	143,600	170,900	333	32,788		0.1
IREIT GLOBAL	57,600	57,600	32	3,202		0.0
EC WORLD REIT	52,800	52,800	28	2,831		0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	235,000	—	—	—		—
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRUST	350,000	436,000	1,255	123,546		0.5
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	538,908	660,808	1,354	133,284		0.5
SUNTEC REIT	239,900	265,900	420	41,335		0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	331,750	432,950	753	74,120		0.3
KEPPEL REIT	202,900	275,800	306	30,120		0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	205,555	260,055	288	28,401		0.1
ESR-LOGOS REIT	398,752	606,713	248	24,474		0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	94,950	94,950	119	11,771		0.0
CAPITALAND CHINA TRUST	113,900	113,900	125	12,327		0.0
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	39,600	48,000	230	22,669		0.1
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	222,800	304,700	575	56,661		0.2
STARHILL GLOBAL REIT	138,200	138,200	80	7,886		0.0
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	117,300	—	—	—		—
AIMS APAC REIT	38,300	38,300	52	5,124		0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	66,700	66,700	51	5,086		0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	243,200	243,200	91	8,973		0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	138,300	262,000	216	21,266		0.1
小計	4,968,253	5,767,414	8,307	817,374		3.3
	口数・金額 銘柄数<比率>	27銘柄		25銘柄		<3.3%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランド・ドル			
KIWI PROPERTY GROUP LTD	147,107	200,506	200	17,016		0.1
ARGOSY PROPERTY LTD	83,275	107,000	146	12,441		0.0
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	46,161	57,519	155	13,180		0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	114,674	123,606	269	22,869		0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	151,115	192,441	261	22,212		0.1
小計	542,332	681,072	1,033	87,719		0.4
	口数・金額 銘柄数<比率>	5銘柄		5銘柄		<0.4%>

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		
(イギリス)						
TRITAX BIG BOX REIT PLC	191,159	236,658	千イギリス・ポンド	412	66,669	0.3
ASSURA PLC	287,670	378,833		254	41,192	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	99,540	118,804		266	43,176	0.2
UNITE GROUP PLC/THE	42,827	52,000		562	91,040	0.4
SAFESTORE HOLDINGS PLC	21,672	25,924		284	46,058	0.2
HOME REIT PLC	65,147	96,051		115	18,681	0.1
PRS REIT PLC/THE	41,845	89,207		93	15,127	0.1
CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	95,185	125,000		157	25,464	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	81,923	99,000		659	106,687	0.4
SEGRE PLC	129,942	157,959		1,548	250,583	1.0
HAMMERSON PLC	440,241	440,241		95	15,529	0.1
BRITISH LAND CO PLC	99,099	118,763		517	83,767	0.3
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	30,485	30,485		160	26,045	0.1
INTU PROPERTIES PLC	28,500	28,500		0	46	0.0
DERWENT LONDON PLC	12,339	15,701		387	62,650	0.3
WORKSPACE GROUP PLC	13,356	20,210		106	17,282	0.1
SHAFTESBURY PLC	27,317	36,339		157	25,460	0.1
BIG YELLOW GROUP PLC	17,172	23,140		306	49,536	0.2
PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141	57,141		51	8,376	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847	117,847		82	13,424	0.1
NEWRIVER REIT PLC	46,021	46,021		39	6,404	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	52,238	108,964		82	13,329	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770	34,770		29	4,793	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	109,811	149,811		187	30,301	0.1
CUSTODIAN REIT PLC	39,999	39,999		41	6,769	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	60,037	95,000		91	14,880	0.1
AEW UK REIT PLC	9,000	9,000		10	1,628	0.0
LXI REIT PLC	62,738	231,365		336	54,433	0.2
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	146,583	182,000		254	41,170	0.2
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	41,816	41,816		49	8,024	0.0
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280	53,280		40	6,569	0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698	70,698		36	5,925	0.0
BALANCED COMM PROPERTY TRUST	89,651	89,651		94	15,260	0.1
REGIONAL REIT LTD	45,664	45,664		32	5,283	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	2,762,713 34銘柄	3,465,842 34銘柄	7,549	1,221,576 <4.9%>	4.9
(イスラエル)						
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT REIT 1 LTD	— 18,096	25,500 26,169	千イスラエル・シェケル	272 567	11,428 23,784	0.0 0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	18,096 1銘柄	51,669 2銘柄	840	35,212 <0.1%>	0.1
(韓国)						
KORAMCO ENERGY PLUS REIT ESR KENDALL SQUARE REIT CO L IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	2,600 14,308 4,067	6,226 24,000 4,067	千韓国・ウォン	33,807 126,960 20,497	3,468 13,026 2,103	0.0 0.1 0.0

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	口数	口数	評価額	組入比率
					外貨建金額	邦貨換算金額
D&D PLATFORM REIT CO LTD	—	6,350	29,146	2,990		0.0
SK REITS CO LTD	—	12,831	72,751	7,464		0.0
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	9,815	9,815	44,363	4,551		0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,302	8,762	68,956	7,074		0.0
LOTTE REIT CO LTD	12,522	12,522	63,236	6,488		0.0
JR REIT XXVII	12,767	19,000	87,970	9,025		0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	61,381 7銘柄	103,573 9銘柄	547,689	56,192	0.2
(ユーロ・・・アイルランド)			千ユーロ			
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	45,608	52,815	65	8,955		0.0
HIBERNIA REIT PLC	71,407	—	—	—		—
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	117,015 2銘柄	52,815 1銘柄	65	8,955	0.0
(ユーロ・・・オランダ)			千ユーロ			
NSI NV	1,955	2,336	72	9,854		0.0
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	3,947	4,841	106	14,590		0.1
WERELDHAVE NV	3,950	5,522	78	10,715		0.0
VASTNED RETAIL NV	2,035	2,035	46	6,358		0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	11,887 4銘柄	14,734 4銘柄	303	41,519	0.2
(ユーロ・・・ベルギー)			千ユーロ			
MONTEA NV	989	1,234	112	15,373		0.1
RETAIL ESTATES	1,586	1,586	105	14,466		0.1
AEDIFICA	3,622	4,810	477	65,316		0.3
COFINIMMO	3,095	4,000	420	57,544		0.2
BEFIMMO	2,652	519	24	3,367		0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA	15,031	18,467	585	80,053		0.3
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	2,388	3,500	90	12,324		0.0
CARE PROPERTY INVEST	3,490	3,490	76	10,475		0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV	1,984	2,441	104	14,353		0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	34,837 9銘柄	40,047 9銘柄	1,998	273,275	1.1
(ユーロ・・・フランス)			千ユーロ			
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12,577	15,400	798	109,256		0.4
ICADE	3,844	3,844	169	23,202		0.1
GECINA SA	5,729	7,026	641	87,721		0.4
KLEPIERRE	20,731	25,069	521	71,374		0.3
COVIVIO	4,944	6,175	347	47,457		0.2
ALTAREA	384	506	67	9,216		0.0
CARMILA	4,754	7,172	112	15,417		0.1
MERCIALYS	6,257	6,257	51	7,097		0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	59,220 8銘柄	71,449 8銘柄	2,711	370,745	1.5
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ			
HAMBORNER REIT AG	9,584	11,000	91	12,575		0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,480	1,760	21	2,967		0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	11,064 2銘柄	12,760 2銘柄	113	15,543	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
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ・・・スペイン)				千ユーロ		
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	34,598	42,596	404	55,337	0.2
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	27,806	34,858	212	29,053	0.1
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940	6,940	32	4,441	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	69,344	84,394	649	88,832	0.4
	銘 柄 数 <比 率>	3銘柄	3銘柄		<0.4%>	
(ユーロ・・・イタリア)				千ユーロ		
	COIMA RES SPA	1,979	—	—	—	—
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,798	4,798	16	2,316	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	6,777	4,798	16	2,316	0.0
	銘 柄 数 <比 率>	2銘柄	1銘柄		<0.0%>	
(ユーロ・・・その他)				千ユーロ		
	CROMWELL REIT EUR	27,720	48,320	98	13,479	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	27,720	48,320	98	13,479	0.1
	銘 柄 数 <比 率>	1銘柄	1銘柄		<0.1%>	
ユーロ通貨計	口 数 ・ 金 額	337,864	329,317	5,957	814,668	3.3
	銘 柄 数 <比 率>	31銘柄	29銘柄		<3.3%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	16,090,503	19,581,055	—	24,664,726	98.8
	銘 柄 数 <比 率>	326銘柄	318銘柄		<98.8%>	

※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。

※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

(2022年8月25日現在)

項	目	期		末
		評	価	比
		額		率
		千円		%
投	資	24,664,726		98.7
コ	ー	325,291		1.3
ル	・	24,990,018		100.0
ロ	ー			
ン	等			
、	そ			
の	の			
他	他			
投	資			
信	託			
財	産			
総	額			

※期末における外貨建資産(24,929,098千円)の投資信託財産総額(24,990,018千円)に対する比率は99.8%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.98円、1カナダ・ドル=105.74円、1オーストラリア・ドル=94.87円、1香港・ドル=17.46円、1シンガポール・ドル=98.39円、1ニュージーランド・ドル=84.87円、1イギリス・ポンド=161.81円、1イスラエル・シケル=41.884円、100韓国・ウォン=10.26円、1ユーロ=136.75円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年8月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	25,054,208,321円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	260,094,482
投 資 証 券 (評価額)	24,664,726,956
未 収 入 金	70,026,908
未 収 配 当 金	59,359,975
(B) 負 債	86,274,353
未 払 金	64,221,343
未 払 解 約 金	22,052,823
そ の 他 未 払 費 用	187
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	24,967,933,968
元 本	8,289,450,618
次 期 繰 越 損 益 金	16,678,483,350
(D) 受 益 権 総 口 数	8,289,450,618口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	30,120円

※当期における期首元本額6,930,002,827円、期中追加設定元本額1,683,021,722円、期中一部解約元本額323,573,931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）	13,654,762円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	14,980,843円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	10,475,502円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,124,195,280円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,899,696円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	51,759,489円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	38,646,421円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	132,066,306円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	73,782,762円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	57,964,497円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	75,422,855円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	619,904円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	185,442,553円
日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）	72,771,799円
日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）	254,523,444円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	16,306,846円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,778,851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>	37,295,369円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド2021-05<リスク3%><適格機関投資家限定>	86,863,439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2022年2月26日 至2022年8月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	443,707,741円
受 取 配 当 金	443,535,617
受 取 利 息	52,572
そ の 他 収 益 金	132,280
支 払 利 息	△ 12,728
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,638,157,428
売 買 益	3,943,848,575
売 買 損	△ 2,305,691,147
(C) そ の 他 費 用 等	△ 9,558,840
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	2,072,306,329
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	11,929,646,039
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 637,092,539
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,313,623,521
(H) 合 計 (D + E + F + G)	16,678,483,350
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	16,678,483,350

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

<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