

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

三井住友・ DCつみたてNISA・ 世界分散ファンド

【運用報告書(全体版)】

(2023年9月12日から2024年9月10日まで)

第 7 期

決算日 2024年9月10日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資を行い、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

三井住友DSアセットマネジメント

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

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

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

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。

■ 最近5期の運用実績

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					
3期(2020年9月10日)	円 10,720	円 0	% 2.7	110.12	% 3.5	% 34.8	% 3.6	% 39.3	% 20.9	百万円 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
6期(2023年9月11日)	14,055	0	4.4	147.68	5.2	37.6	0.8	38.8	20.8	2,217
7期(2024年9月10日)	15,445	0	9.9	163.62	10.8	36.2	0.9	39.8	21.1	3,111

※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、円ヘッジ換算ベース)5%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)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、円換算ベース)20%、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)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) 2023年 9月11日	14,055	—	147.68	—	37.6	0.8	38.8	20.8
9 月 末	13,856	△ 1.4	145.60	△ 1.4	36.9	1.4	39.5	20.4
10 月 末	13,518	△ 3.8	142.05	△ 3.8	36.6	1.3	39.8	20.2
11 月 末	14,231	1.3	149.82	1.4	36.7	1.3	38.7	21.2
12 月 末	14,469	2.9	152.46	3.2	36.6	1.4	38.8	21.1
2024年 1 月 末	14,753	5.0	155.49	5.3	37.0	1.7	38.9	20.6
2 月 末	15,094	7.4	159.16	7.8	37.3	1.7	38.7	20.3
3 月 末	15,494	10.2	163.55	10.7	37.1	1.3	38.5	21.0
4 月 末	15,579	10.8	164.50	11.4	37.1	1.3	39.1	20.9
5 月 末	15,669	11.5	165.56	12.1	36.7	1.7	39.1	20.8
6 月 末	16,191	15.2	171.21	15.9	37.3	1.4	39.0	20.8
7 月 末	15,834	12.7	167.45	13.4	36.3	0.9	39.1	21.3
8 月 末	15,662	11.4	165.91	12.3	36.7	1.4	38.9	20.9
(期 末) 2024年 9月10日	15,445	9.9	163.62	10.8	36.2	0.9	39.8	21.1

※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(2023年9月12日から2024年9月10日まで)

基準価額等の推移



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

期首	14,055円
期末	15,445円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+9.9% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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

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

※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、円ヘッジ換算ベース)5%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)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、円換算ベース)20%、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)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(2023年9月12日から2024年9月10日まで)

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

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

上昇要因

- 米国での良好な企業決算などから、国内外の株式市場が上昇し、グローバルリート市場が上昇したこと
- インフレ鈍化に伴う利下げ期待から海外金利が低下(債券価格は上昇)したこと

下落要因

- 日銀による利上げへの警戒感から、国内金利が上昇し、国内リート市場が下落したこと
- 日銀の利上げやF R B(米連邦準備制度理事会)による利下げ期待から、米ドルに対して円高が進行したこと

投資環境について(2023年9月12日から2024年9月10日まで)

期を通して見ると、国内株式市場、先進国外国株式市場、新興国株式市場は、それぞれ上昇しました。債券市場では、国内金利は上昇となった一方、欧米金利は低下しました。国内リート市場は下落、グローバルリート市場は上昇しました。外国為替市場では、米ドルは円に対して下落となった一方で、ユーロは概ね横ばい、新興国通貨はまちまちながら円に対して概ね下落しました。

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上昇しました。

期初から10月にかけては、米欧の長期金利(10年国債利回り)が上昇し、下落基調となりました。11月以降、欧米中銀の利上げ終了観測などを背景に反転する中、良好な企業決算などから投資家心理が改善し、2024年7月にかけて上昇基調となりました。その後、米景気後退懸念が一時強まり、8月にかけて下落する場面もありましたが、欧米中銀の利下げ期待が高まる中、期末にかけて堅調さを維持しました。

●国内株式

期を通じて、国内株式市場は上昇しました。

期初より、上値が重く軟調な展開となりましたが、1月以降は、米ドル高・円安の進行や海外投資家の資金流入などにより、

上昇基調となりました。夏場以降は、乱高下する展開となり、米ドル高・円安の一段の進行や米国株高を背景に、7月には日本株は史上最高値を更新しました。しかし、日銀の利上げ決定や米国の景気後退懸念などが生じたことで、米ドル安・円高が加速し、8月にかけて大幅下落となりました。期末にかけては、日銀の追加利上げ懸念が後退したことなどから、急速に反発しました。

●新興国株式

期を通じて、新興国株式市場は上昇しました。

期初から10月にかけて、米国の長期金利上昇、中国の景気減速、中東情勢の緊迫化などを背景に、新興国株式市場は軟調な展開となりました。11月以降は、インフレ鈍化に伴う欧米中銀の利下げ期待や半導体の需要回復期待などに支えられ、グローバルに投資家のリスク選好姿勢が強まる中、米国経済のソフトランディング(軟着陸)観測

や生成AI開発需要の増加を受けた韓国や台湾の半導体企業の業績改善、内需拡大に伴うインド経済の高成長見通しなどが支援材料となって、期末にかけて上昇基調となりました。

債券市場

●先進国外国債券

米国や欧州の長期金利は、期を通じて低下しました。

期初より10月にかけては、欧米の中央銀行がタカ派(インフレ抑制を重視する立場)姿勢を強めたことで金利は上昇しました。しかし、11月以降、インフレ指標の減速などを背景に欧米中銀がタカ派姿勢を弱めたことで利上げ終了観測が強まり、年末にかけて金利は大きく低下しました。1月以降は、景気の底堅さや根強いインフレ圧力が意識され、5月にかけて金利は再び上昇しましたが、その後はインフレ圧力の鈍化傾向を受けて、欧米中銀の金融政策の転換が意識されたことから、金利は低下する展開となりました。また、期末にかけてもFRBによる9月の利下げ開始が意識されたことから、金利は更に低下しました。

●国内債券

日本の長期金利は、期を通じて上昇しました。

期初より、日銀による早期の緩和修正観

測や米長期金利の上昇を受けて、国内金利も上昇基調で推移し、10月には日銀のYCC(イールドカーブ・コントロール、長短金利操作)政策修正の決定により、一段と上昇しました。

年末にかけては、欧米金利の低下に連れ、日本の金利も低下に転じましたが、その後は再び上昇し、3月には日銀のマイナス金利政策の解除やYCC撤廃の決定により、先行きの利上げへの警戒感が高まったことや、海外金利が上昇基調で推移したことから、国内金利も上昇基調となりました。その後、7月に日銀が政策金利を0.25%程度まで引き上げたものの、ハト派(景気を重視する立場)なFOMC(米連邦公開市場委員会)や米景気減速懸念の高まり等を背景に海外金利が大きく低下したことから国内金利も上昇幅を縮小しました。

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上昇しました。

期初から10月にかけて、中東の地政学リスク台頭によるインフレ懸念を受けて下落しましたが、年末にかけては米利上げ局面が終了し、利下げに転じるとの観測から大きく上昇しました。1月以降は、米景気の堅調さによる利下げ観測の後退から米長期金利が上昇し、軟調な展開となる場面もあ

りましたが、期末にかけては、FRBによる9月の利下げ観測の高まりを好感し、上昇基調となりました。

●国内リート

国内リート市場は、期を通じて下落しました。

期初より、米国長期金利が上昇したことや、日銀の金融緩和政策見直しにより国内長期金利が上昇したことで、リート市場は軟調に推移しました。3月の日銀会合で金融政策が修正され、先行き不透明感が解消し上昇に転じたものの、5月には日銀が金融政策正常化を早めるとの思惑から下落しました。8月に米景気懸念の高まりから一時的に大きく下落しましたが、期末にかけては日銀が追加利上げに慎重な姿勢を示したことなどを受けて、反発しました。

為替市場

●米ドル・円

米ドル・円は、期を通じて、米ドル安・円高となりました。

期初より、緩やかな米ドル高・円安基調が続きましたが、11月以降はFRBによる利上げ終了観測の高まりを背景に、年末にかけて一時的に米ドル安・円高が進みました。2024年1月から7月にかけては、再び日米金利差が意識される中、円安基調で推移しました。その後、日本の政府・日銀に

よる円買い介入や、米国の景気後退懸念の高まりなどから、急速に米ドル安・円高が進み、期末には期初の水準を下回りました。

●ユーロ・円

ユーロ・円は、期を通じて、概ね横ばいとなりました。

期初より、ECB(欧州中央銀行)による利上げ終了観測の高まりを背景に、一時的にユーロ安・円高に振れる場面もありましたが、2024年1月から7月にかけては、日欧の金利差が意識される中、円安基調で推移しました。その後、リスク回避の動きが見られる中、日銀の利上げやECBの追加利下げ観測も加わり、急速にユーロ安・円高が進み、期末には概ね期初の水準にまで戻りました。

●新興国通貨

新興国通貨は一部通貨を除き、概ね円に対して下落しました。

期初より、多くの新興国通貨で一進一退の展開となりました。7月以降は、日本の政府・日銀による円買い介入や利上げが意識されたことで、メキシコペソをはじめとする多くの新興国通貨が円に対して下落する展開となりました。

ポートフォリオについて(2023年9月12日から2024年9月10日まで)

当ファンド

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

マザーファンドへの投資を通じて行う各資産への実質的な投資は、基本資産配分に基づき実施しました。

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。

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)(投資資金の平均回収期間)、満期・債券種別・格付け構成などをベンチマークに合わせてつ、個別銘柄については

分散投資を図りました。また、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値(デュレーションなど)をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランス(投資配分比率の調整)を行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。具体的には、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、円換算ベース)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、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

MSCIコクサイ・インデックス(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、株式組入比率は期を通じて概ね100%(投資信託証券、先物含む)を維持しました。

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

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

エマージング株式インデックス・マザーファンド

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

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MSCI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REIT指数(配当込み)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、原則として指数採用銘柄への時価構成比に応じた投資を行いました。

組入比率は期を通じて高位を保ちました。

外国リート・インデックス・マザーファンド

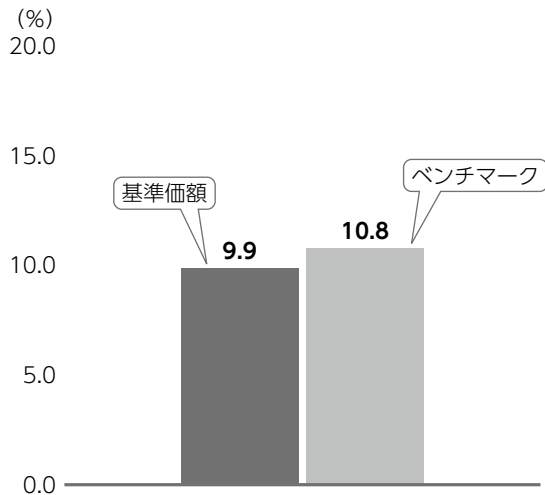
S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

日々の追加設定・解約による資金移動に応じてリートの売買を行い、トラッキングエラーの抑制に努めました。

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

ベンチマークとの差異について(2023年9月12日から2024年9月10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。記載のグラフは、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+9.9%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+10.8%を0.9%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 信託報酬等の費用がかかったこと

分配金について(2023年9月12日から2024年9月10日まで)

(単位:円、1万口当たり、税引前)

項目	第7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	5,444

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

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

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

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、マザーファンドへの投資を通じて、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いる

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、流動性等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、円ヘッジ換算ベース)に連動

する投資成果を目指して運用を行います。

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

通貨に関してはフルヘッジを継続します。

債券組入比率は高位に保つことを基本とします。

外国債券パッシブ・マザーファンド

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

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。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。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。

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

引き続き、S & P先進国REIT指数(除

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。

当ファンドが組み入れるマザーファンドにかかる損害賠償請求訴訟の和解成立と和解金について

2015年に発覚した株式会社東芝の有価証券報告書等の虚偽記載に関し、当ファンドが組み入れる国内株式インデックス・マザーファンド(B号)が被った損害の回復を目的として、2017年3月31日に同社に対して損害賠償請求訴訟を提起しておりましたが、2023年10月30日に和解が成立いたしました。なお、本訴訟でかかった費用1,278,614円と和解金20,900,572円は2023年12月13日に当該マザーファンドに計上しております。また、この和解金の受領に伴う当該マザーファンドの基準価額への影響は+3円程度となります。

1万口当たりの費用明細(2023年9月12日から2024年9月10日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	35円	0.230%	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15,029円です。
(投信会社)	(15)	(0.099)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(16)	(0.110)	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	2	0.012	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)	(1)	(0.006)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(1)	(0.005)	
(c) 有価証券取引税	1	0.003	有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.003)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	6	0.039	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)	(0.030)	保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送回金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.007)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.003)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	43	0.286	

※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。

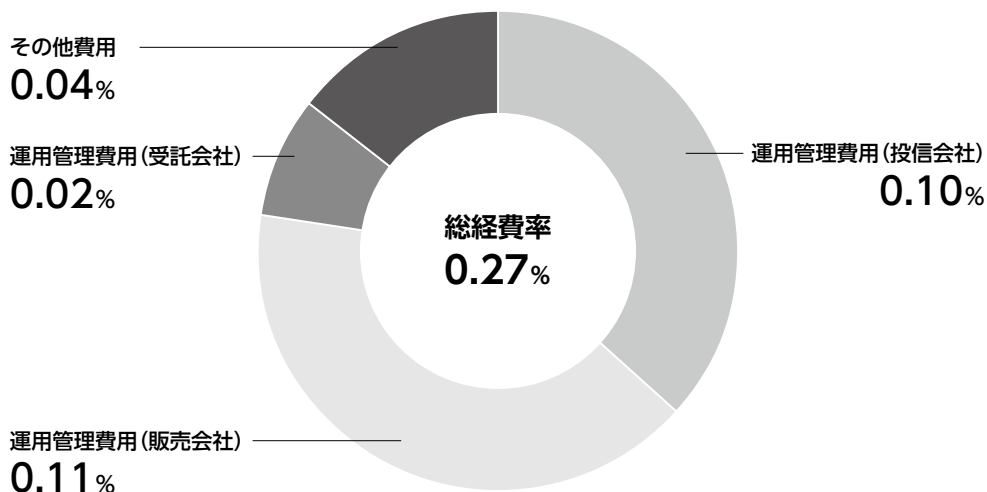
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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0.27%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2023年9月12日から2024年9月10日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	13,571	62,194	2,699	12,272
外国株式インデックス・マザーファンド	11,037	93,760	3,260	27,266
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	42,415	51,435	38	47
外国債券パッシブ・マザーファンド	71,922	161,930	3,384	7,318
国内債券パッシブ・マザーファンド	134,253	161,165	8,434	10,091
Jリート・インデックス・マザーファンド	21,724	55,602	527	1,377
外国リート・インデックス・マザーファンド	27,657	86,561	6,974	21,953
エマージング株式インデックス・マザーファンド	30,611	60,123	1,194	2,504

■ 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

(2023年9月12日から2024年9月10日まで)

項 目	当 期		
	国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	外国株式インデックス・マザーファンド	エマージング株式インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33,981,977千円	117,254,329千円	8,445,210千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	310,480,818千円	685,647,109千円	34,688,441千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.11	0.17	0.24

※(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 (2023年9月12日から2024年9月10日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

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 56,794	百万円 4,427	% 7.8	百万円 44,329	百万円 2,469	% 5.6

※平均保有割合 0.3%

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

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 24,891	百万円 207	% 0.8	百万円 9,094	百万円 204	% 2.3

※平均保有割合 0.1%

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

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 6,318	百万円 629	% 10.0	百万円 3,129	百万円 853	% 27.3

※平均保有割合 0.9%

※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 99

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 292	百万円 65	百万円 5,456

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 1,200

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 98

(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	334千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	0千円
(c) (b) / (a)	0.3%

※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
(2023年9月12日から2024年9月10日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2024年9月10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)	54,438	65,310	300,284
外国株式インデックス・マザーファンド	60,936	68,713	600,775
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	85,609	127,986	158,638
外国債券パッシブ・マザーファンド	208,489	277,027	623,034
国内債券パッシブ・マザーファンド	269,611	395,430	473,251
Jリート・インデックス・マザーファンド	39,990	61,188	160,196
外国リート・インデックス・マザーファンド	111,536	132,220	470,333
エマージング株式インデックス・マザーファンド	120,116	149,533	296,002

※各親投資信託の期末の受益権総口数は以下の通りです。

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	69,995,003,999口	外国株式インデックス・マザーファンド	88,896,330,594口
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	29,557,197,477口	外国債券パッシブ・マザーファンド	80,456,963,120口
国内債券パッシブ・マザーファンド	115,030,780,551口	Jリート・インデックス・マザーファンド	6,014,675,226口
外国リート・インデックス・マザーファンド	11,482,382,596口	エマージング株式インデックス・マザーファンド	23,413,171,122口

■ 投資信託財産の構成

(2024年9月10日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	300,284	9.6
Jリート・インデックス・マザーファンド	160,196	5.1
国内債券パッシブ・マザーファンド	473,251	15.2
外国株式インデックス・マザーファンド	600,775	19.3
外国リート・インデックス・マザーファンド	470,333	15.1
エマージング株式インデックス・マザーファンド	296,002	9.5
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	158,638	5.1
外国債券パッシブ・マザーファンド	623,034	20.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	34,176	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	3,116,693	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（776,947,777千円）の投資信託財産総額（777,569,291千円）に対する比率は99.9%です。

※ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（35,873,998千円）の投資信託財産総額（36,646,306千円）に対する比率は97.9%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（180,102,451千円）の投資信託財産総額（181,203,527千円）に対する比率は99.4%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（40,793,600千円）の投資信託財産総額（40,845,599千円）に対する比率は99.9%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（46,247,942千円）の投資信託財産総額（46,408,277千円）に対する比率は99.7%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=143.53円、1カナダ・ドル=105.78円、1オーストラリア・ドル=95.45円、1香港・ドル=18.40円、1シンガポール・ドル=109.82円、1ニュージーランド・ドル=88.03円、1台湾・ドル=4.469円、1イギリス・ポンド=187.52円、1エジプト・ポンド=2.966円、1イスラエル・シェケル=38.182円、1スイス・フラン=168.92円、1トルコ・リラ=4.213円、1デンマーク・クローネ=21.22円、1ノルウェー・クローネ=13.23円、1スウェーデン・クローナ=13.83円、1メキシコ・ペソ=7.212円、1フィリピン・ペソ=2.542円、100チリ・ペソ=15.188円、100コロンビア・ペソ=3.381円、1インド・ルピー=1.72円、100インドネシア・ルピア=0.93円、1ブラジル・レアル=25.689円、1チェコ・コルナ=6.319円、100韓国・ウォン=10.68円、1オフショア・人民元=20.141円、1マレーシア・リンギット=32.845円、1南アフリカ・ランド=8.01円、1タイ・バーツ=4.23円、1ポーランド・ズロチ=37.026円、100ハンガリー・フォリント=39.896円、1ユーロ=158.33円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年9月10日現在)

項目	期末
(A) 資産	3,116,693,019円
コーポレート債券等	34,176,607
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	300,284,106
Jリート・インデックス・マザーファンド(評価額)	160,196,598
国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	473,251,356
外国株式インデックス・マザーファンド(評価額)	600,775,418
外国リート・インデックス・マザーファンド(評価額)	470,333,482
エマージング株式インデックス・マザーファンド(評価額)	296,002,418
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	158,638,758
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	623,034,276
(B) 負債	4,737,829
未払解約金	1,240,103
未払信託報酬	3,400,626
その他未払費用	97,100
(C) 純資産総額(A-B)	3,111,955,190
元本	2,014,912,827
次期繰越損益金	1,097,042,363
(D) 受益権総口数	2,014,912,827口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,445円

※当期における期首元本額1,577,588,079円、期中追加設定元本額620,093,815円、期中一部解約元本額182,769,067円です。

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

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

■ 分配金のお知らせ

	当	期
1万口当たり分配金(税引前)		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。

■ 損益の状況

(自2023年9月12日 至2024年9月10日)

項目	当期
(A) 配当等収益	13,506円
受取利息	16,956
支払利息	△ 3,450
(B) 有価証券売買損益	222,152,484
売買益	244,064,454
売買損	△ 21,911,970
(C) 信託報酬等	△ 6,326,803
(D) 当期損益金(A+B+C)	215,839,187
(E) 前期繰越損益金	263,534,310
(F) 追加信託差損益金	617,668,866
(配当等相当額)	(457,031,748)
(売買損益相当額)	(160,637,118)
(G) 合計(D+E+F)	1,097,042,363
次期繰越損益金(G)	1,097,042,363
追加信託差損益金	617,668,866
(配当等相当額)	(458,249,619)
(売買損益相当額)	(159,419,247)
分配準備積立金	479,373,497

※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	61,676,166円	
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	154,163,021	
(c) 収益調整金	617,668,866	
(d) 分配準備積立金	263,534,310	
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,097,042,363	
1万口当たり当期分配対象額	5,444.61	
(f) 分配金	0	
1万口当たり分配金	0	

国内債券パッシブ・マザーファンド

第19期（2023年5月26日から2024年5月27日まで）

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

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
		期中 騰落率		期中 騰落率		
	円	%		%	%	百万円
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
18期(2023年5月25日)	12,406	△1.5	374.83	△1.6	99.4	126,876
19期(2024年5月27日)	11,844	△4.5	357.72	△4.6	99.4	132,104

※NOMURA-BPI（総合）は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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

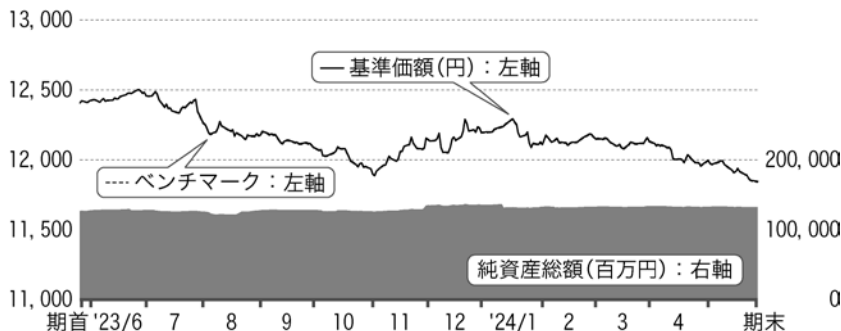
年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合)		公 社 債 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2023年5月25日	円 12,406	% —	374.83	% —	% 99.4
5月末	12,425	0.2	375.27	0.1	99.4
6月末	12,456	0.4	376.29	0.4	99.5
7月末	12,267	△1.1	370.43	△1.2	99.5
8月末	12,177	△1.8	367.76	△1.9	99.4
9月末	12,089	△2.6	365.13	△2.6	99.5
10月末	11,895	△4.1	359.31	△4.1	99.5
11月末	12,147	△2.1	366.88	△2.1	97.3
12月末	12,197	△1.7	368.38	△1.7	99.5
2024年1月末	12,109	△2.4	365.75	△2.4	99.3
2月末	12,149	△2.1	366.90	△2.1	99.4
3月末	12,135	△2.2	366.50	△2.2	99.4
4月末	11,997	△3.3	362.35	△3.3	99.6
(期 末) 2024年5月27日	11,844	△4.5	357.72	△4.6	99.4

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について (2023年5月26日から2024年5月27日まで)

基準価額等の推移



期首	12,406円
期末	11,844円
騰落率	-4.5%

※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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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。

▶ 基準価額の変動要因 (2023年5月26日から2024年5月27日まで)

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

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> 11月から2024年1月にかけて、インフレ鈍化を背景に海外中央銀行が金融引き締め姿勢を後退させ、海外金利が低下したことに追随して、国内金利が低下（債券価格は上昇）したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> 7月から10月にかけて、日銀が長期金利（10年国債利回り）の変動幅を抑制するためのイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の運用柔軟化を進め、実質的な上限を引き上げたことから、国内金利が上昇したこと 1月から期末にかけて、日銀によるマイナス金利解除やさらなる利上げなどへの警戒から、国内金利が上昇したこと

▶ 投資環境について (2023年5月26日から2024年5月27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。

期初は、植田新総裁となった日銀が金融緩和政策の継続姿勢を示したことで、長期金利は0.5%を下回る水準での推移を続けました。

7月の金融政策決定会合で、日銀はイールドカーブ・コントロールの運用柔軟化を決定し、長期金利の変動幅は $0 \pm 0.50\%$ 程度を目途としつつも、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）の水準を0.5%から1.0%へ引き上げたことから、金利は上昇基調となりました。海外金利の大幅な上昇を受けて国内金利の上昇が続くと、10月には、日銀は長期金利の上昇の目途を1.0%とするなどイールドカーブ・コントロールの一段の運用柔軟化を決定しました。

11月以降は、米国でFRB（米連邦準備制度理事会）議長がハト派（景気を重視する立場）姿勢を示したことや経済指標の悪化をきっかけに米国金利が大きく低下したことから、国内金利も低下に転じました。しかし、1月に国債入札の不調な結果が続き投資家需要の乏しさが確認されたことや、同月の金融政策決定会合後の植田日銀総裁の会見が政策変更が近づいていることを意識させるタカ派（インフレ抑制を重視する立場）的な内容であったことから、金利は再び上昇しました。

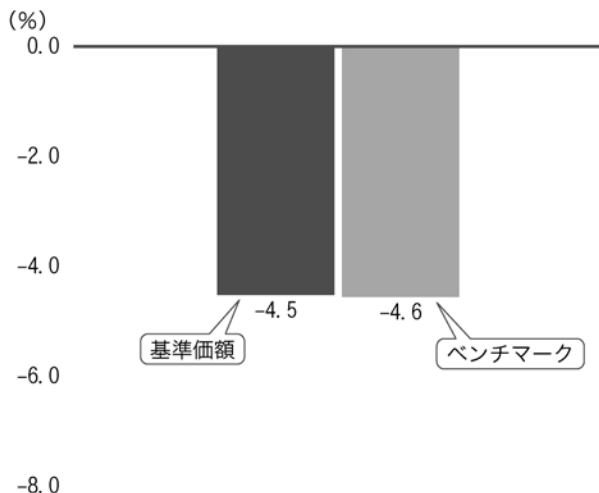
3月に日銀はマイナス金利の解除やイールドカーブ・コントロールの撤廃を決定しましたが、事前に市場で織込みが進んでいたため当初の反応は限定的でした。しかし、4月以降は先行きの利上げへの警戒が高まったことや、日銀が国債買入れを減額したことから、期末にかけて長期金利は上昇基調となりました。

▶ ポートフォリオについて (2023年5月26日から2024年5月27日まで)

デュレーション（投資資金の平均回収期間：金利の変動による債券価格の感応度）、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 (2023年5月26日から2024年5月27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。
記載のグラフは、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-4.5%となり、ベンチマークの騰落率-4.6%に概ね連動した運用結果となりました。

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(2023年5月26日から2024年5月27日まで)

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

期中の平均基準価額は12,162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(2023年5月26日から2024年5月27日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	44,638,779	33,419,296
	地方債証券	1,334,242	2,408,879
	特殊債証券	2,490,035	904,770 (257,068)
	社債証券	1,593,122	399,287 (400,000)

※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。

■ 利害関係人との取引状況等(2023年5月26日から2024年5月27日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 50,056	百万円 3,908	% 7.8	百万円 37,132	百万円 6,821	% 18.4

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	—	—	100

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, 100

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、S M B 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 (2023年5月26日から2024年5月27日まで)

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

■ 組入れ資産の明細(2024年5月27日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	110,492,000 (63,650,000)	104,997,591 (58,603,363)	79.5 (44.4)	— (—)	53.2 (27.1)	19.5 (12.5)	6.8 (4.8)
地 方 債 証 券	8,800,000 (8,800,000)	8,907,510 (8,907,510)	6.7 (6.7)	— (—)	2.3 (2.3)	2.3 (2.3)	2.1 (2.1)
特 殊 債 券 (除く金融債券)	9,963,845 (9,963,845)	10,238,499 (10,238,499)	7.8 (7.8)	— (—)	4.1 (4.1)	2.5 (2.5)	1.1 (1.1)
普 通 社 債 券	7,300,000 (7,300,000)	7,198,481 (7,198,481)	5.4 (5.4)	— (—)	1.8 (1.8)	3.4 (3.4)	0.2 (0.2)
合 計	136,555,845 (89,713,845)	131,342,083 (84,947,855)	99.4 (64.3)	— (—)	61.5 (35.4)	27.7 (20.6)	10.3 (8.3)

※()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。

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	145 5年国債	0.1000	1,180,000	1,178,218	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	140,000	140,338	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	420,000	430,378	2025/09/20
	454 2年国債	0.1000	60,000	59,871	2025/11/01
	455 2年国債	0.0050	1,030,000	1,025,880	2025/12/01
	146 5年国債	0.1000	1,000,000	997,270	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	557,000	557,211	2025/12/20
	84 20年国債	2.0000	500,000	513,475	2025/12/20
	456 2年国債	0.1000	230,000	229,321	2026/01/01
	457 2年国債	0.1000	500,000	498,325	2026/02/01
	458 2年国債	0.2000	180,000	179,636	2026/03/01
	147 5年国債	0.0050	1,310,000	1,302,559	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	350,000	348,610	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	645,000	665,730	2026/03/20
	459 2年国債	0.2000	410,000	409,020	2026/04/01
	460 2年国債	0.3000	440,000	439,617	2026/05/01
	148 5年国債	0.0050	1,180,000	1,171,421	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	310,000	308,347	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	742,000	771,553	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	20,000	20,755	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	1,290,000	1,279,189	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	811,000	805,971	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	580,000	604,429	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	3,130,000	3,099,795	2026/12/20
	345 10年国債	0.1000	258,000	256,132	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	324,000	338,152	2026/12/20
	151 5年国債	0.0050	300,000	296,706	2027/03/20
	152 5年国債	0.1000	730,000	723,911	2027/03/20
	346 10年国債	0.1000	340,000	337,164	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	632,000	660,288	2027/03/20
	153 5年国債	0.0050	800,000	790,072	2027/06/20
	347 10年国債	0.1000	100,000	99,047	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	305,000	322,485	2027/06/20
	154 5年国債	0.1000	1,220,000	1,206,641	2027/09/20
	348 10年国債	0.1000	145,000	143,412	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	327,000	345,972	2027/09/20
	156 5年国債	0.2000	1,280,000	1,268,544	2027/12/20
	349 10年国債	0.1000	650,000	641,901	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	153,000	161,883	2027/12/20
	157 5年国債	0.2000	370,000	366,189	2028/03/20
	158 5年国債	0.1000	980,000	966,240	2028/03/20
	350 10年国債	0.1000	510,000	502,839	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	207,000	220,488	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	355,000	380,790	2028/03/20
	159 5年国債	0.1000	100,000	98,407	2028/06/20
	160 5年国債	0.2000	1,190,000	1,175,779	2028/06/20

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
	161 5年国債	0.3000	370,000	367,051	2028/06/20
	351 10年国債	0.1000	350,000	344,424	2028/06/20
	102 20年国債	2.4000	457,000	491,869	2028/06/20
	162 5年国債	0.3000	220,000	217,863	2028/09/20
	163 5年国債	0.4000	770,000	765,772	2028/09/20
	352 10年国債	0.1000	150,000	147,279	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	370,000	394,753	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	370,000	396,314	2028/09/20
	164 5年国債	0.2000	240,000	236,049	2028/12/20
	165 5年国債	0.3000	1,510,000	1,491,849	2028/12/20
	166 5年国債	0.4000	440,000	436,766	2028/12/20
	353 10年国債	0.1000	180,000	176,274	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	378,000	404,085	2028/12/20
	167 5年国債	0.4000	140,000	138,721	2029/03/20
	354 10年国債	0.1000	365,000	356,630	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	40,000	42,480	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	660,000	643,942	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	386,000	416,961	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	280,000	272,787	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	27,000	29,123	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	800,000	778,040	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	163,000	176,354	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	440,000	484,303	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	1,010,000	980,265	2030/03/20
	359 10年国債	0.1000	1,130,000	1,094,066	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	200,000	216,190	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	295,000	315,431	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	200,000	211,452	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	1,150,000	1,110,612	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	55,000	59,224	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	130,000	139,194	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	340,000	388,065	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	1,120,000	1,078,492	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	70,000	76,365	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	1,120,000	1,075,256	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	205,000	225,428	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	180,000	195,528	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	145,000	156,565	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	290,000	319,258	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	1,030,000	985,751	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	65,000	70,249	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	980,000	934,204	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	155,000	166,459	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	80,000	85,358	2031/09/20
	365 10年国債	0.1000	1,040,000	987,719	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	450,000	480,082	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	190,000	204,134	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	1,170,000	1,116,332	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	200,000	215,018	2032/03/20

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
	135 20年国債	1.7000	155,000	165,437	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	120,000	127,197	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	474,000	527,912	2032/05/20
	367 10年国債	0.2000	1,110,000	1,055,554	2032/06/20
	137 20年国債	1.7000	185,000	197,535	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	60,000	63,587	2032/06/20
	368 10年国債	0.2000	1,190,000	1,127,727	2032/09/20
	140 20年国債	1.7000	420,000	448,421	2032/09/20
	369 10年国債	0.5000	1,140,000	1,104,614	2032/12/20
	9 30年国債	1.4000	240,000	250,336	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	360,000	384,426	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	240,000	258,201	2032/12/20
	370 10年国債	0.5000	1,190,000	1,149,730	2033/03/20
	10 30年国債	1.1000	95,000	96,590	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	150,000	158,830	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	170,000	178,617	2033/03/20
	371 10年国債	0.4000	1,010,000	964,045	2033/06/20
	11 30年国債	1.7000	430,000	458,822	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	110,000	117,373	2033/06/20
	372 10年国債	0.8000	970,000	956,720	2033/09/20
	12 30年国債	2.1000	570,000	628,242	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	195,000	207,959	2033/09/20
	373 10年国債	0.6000	1,100,000	1,061,588	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	840,000	887,090	2033/12/20
	374 10年国債	0.8000	340,000	333,325	2034/03/20
	14 30年国債	2.4000	392,000	442,811	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	459,000	479,930	2034/03/20
	149 20年国債	1.5000	625,000	652,675	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	205,000	233,751	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	571,000	589,871	2034/09/20
	151 20年国債	1.2000	700,000	707,959	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	190,000	212,953	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	640,000	645,868	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	170,000	190,495	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	587,000	597,102	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	650,000	652,925	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	345,000	386,679	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	510,000	500,146	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	315,000	359,966	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	300,000	273,615	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	349,000	398,910	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	385,000	341,013	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	460,000	525,568	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	380,000	347,726	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	260,000	290,906	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	388,000	357,891	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	253,000	285,917	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	445,000	413,858	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	610,000	557,643	2037/06/20

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
	27 30年国債	2.5000	250,000	285,345	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	560,000	509,717	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	560,000	507,483	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	96,000	109,423	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	545,000	484,586	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	600,000	530,628	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	157,000	176,670	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	495,000	448,331	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	530,000	463,871	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	142,000	157,483	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	520,000	445,816	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	480,000	402,792	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	235,000	256,765	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	385,000	321,063	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	475,000	393,879	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	360,000	397,058	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	480,000	402,240	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	545,000	454,170	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	208,000	219,901	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	700,000	580,062	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	685,000	574,304	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	87,000	94,164	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	670,000	558,666	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	670,000	545,768	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	260,000	272,989	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	650,000	536,328	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	690,000	566,138	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	90,000	94,140	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	550,000	474,221	2042/03/20
	181 20年国債	0.9000	590,000	515,506	2042/06/20
	37 30年国債	1.9000	225,000	230,800	2042/09/20
	182 20年国債	1.1000	550,000	495,599	2042/09/20
	183 20年国債	1.4000	570,000	538,644	2042/12/20
	38 30年国債	1.8000	220,000	221,243	2043/03/20
	184 20年国債	1.1000	590,000	527,513	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	220,000	224,235	2043/06/20
	185 20年国債	1.1000	590,000	525,412	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	260,000	260,184	2043/09/20
	186 20年国債	1.5000	480,000	457,065	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	240,000	235,672	2043/12/20
	187 20年国債	1.3000	450,000	412,371	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	280,000	274,108	2044/03/20
	188 20年国債	1.6000	100,000	96,236	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	295,000	288,312	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	310,000	302,463	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	315,000	296,147	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	315,000	295,545	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	310,000	295,563	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	400,000	366,596	2045/09/20

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
	49 30年国債	1.4000	345,000	315,474	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	325,000	261,797	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	345,000	245,809	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	363,000	270,231	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	297,000	225,342	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	115,000	91,029	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	355,000	280,027	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	330,000	259,399	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	325,000	254,387	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	40,000	43,278	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	350,000	272,793	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	360,000	272,674	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	360,000	285,184	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	345,000	258,963	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	242,000	251,483	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	275,000	194,804	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	157,639	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	315,000	214,773	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	275,000	186,675	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	185,000	191,623	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	360,000	243,115	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	410,000	291,669	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	360,000	254,865	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	370,000	268,398	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	247,000	254,508	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	370,000	267,384	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	360,000	259,164	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	370,000	265,345	2051/09/20
	73 30年国債	0.7000	380,000	271,479	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	235,000	231,279	2052/03/20
	74 30年国債	1.0000	380,000	294,211	2052/03/20
	75 30年国債	1.3000	360,000	300,650	2052/06/20
	76 30年国債	1.4000	370,000	316,150	2052/09/20
	77 30年国債	1.6000	350,000	313,435	2052/12/20
	6 40年国債	1.9000	240,000	230,143	2053/03/20
	78 30年国債	1.4000	400,000	340,568	2053/03/20
	79 30年国債	1.2000	320,000	258,457	2053/06/20
	80 30年国債	1.8000	360,000	336,736	2053/09/20
	81 30年国債	1.6000	380,000	338,549	2053/12/20
	7 40年国債	1.7000	265,000	241,579	2054/03/20
	82 30年国債	1.8000	140,000	130,622	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	300,000	251,538	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	523,000	314,992	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	470,000	332,948	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	370,000	249,938	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	400,000	237,400	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	525,000	306,069	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	525,000	326,329	2061/03/20
	15 40年国債	1.0000	570,000	391,629	2062/03/20

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
	16 40年国債	1.3000	570,000	429,341	2063/03/20
	小計	—	110,492,000	104,997,591	—
地方債証券	1-6 京都府5年	0.0010	200,000	199,922	2024/09/19
	26-4 千葉県公債	0.5540	100,000	100,136	2024/09/25
	138 共同発行地方	0.5540	200,000	200,273	2024/09/25
	1-2 北九州市5年	0.0010	100,000	99,951	2024/09/26
	388 大阪府公債	0.5400	100,000	100,136	2024/09/27
	210 神奈川県公債	0.4510	100,000	100,158	2024/12/20
	211 神奈川県公債	0.4380	100,000	100,147	2024/12/20
	26-17 神戸市公債	0.2800	100,000	100,048	2025/01/27
	392 大阪府公債	0.3600	100,000	100,107	2025/01/29
	26-10 福岡県公債	0.4530	100,000	100,175	2025/02/26
	26-15 北海道公債	0.4340	100,000	100,155	2025/02/27
	6 東京都20年	2.0000	100,000	101,431	2025/03/19
	4 横浜市20年	2.0300	100,000	101,451	2025/03/19
	27-4 京都府公債	0.5530	100,000	100,307	2025/06/19
	3 神奈川県20年	2.1100	100,000	101,964	2025/06/20
	3 名古屋市20年	2.0300	100,000	101,874	2025/06/20
	27-3 千葉県公債	0.5240	100,000	100,277	2025/06/25
	1 静岡県20年	2.1800	100,000	102,492	2025/09/19
	7 横浜市20年	2.0600	100,000	102,681	2025/12/19
	27-16 愛知県公債	0.4540	400,000	400,696	2025/12/25
	179 大阪府5年	0.0010	100,000	99,404	2026/01/28
	155 共同発行地方	0.2200	100,000	99,727	2026/02/25
	28-1 千葉県公債	0.0800	100,000	99,347	2026/05/25
	9 横浜市20年	2.3500	100,000	103,964	2026/06/19
	5 名古屋市20年	2.3000	100,000	104,279	2026/09/18
	7 神奈川県20年	2.2200	100,000	104,893	2027/03/19
	193 大阪府5年	0.0010	300,000	296,051	2027/03/30
	170 共同発行地方	0.1800	400,000	396,522	2027/05/25
	29-4 京都府公債	0.1900	100,000	99,135	2027/06/21
	172 共同発行地方	0.2250	500,000	496,048	2027/07/23
	5 埼玉県20年	2.3500	100,000	106,836	2028/03/17
	14 横浜市20年	2.3200	100,000	106,728	2028/03/17
	5 兵庫県公債15年	1.3100	300,000	309,034	2028/05/26
	183 共同発行地方	0.2050	600,000	591,562	2028/06/23
	7 京都市20年	2.3800	100,000	107,664	2028/09/21
	30-18 北海道公債	0.1460	200,000	195,373	2029/02/28
	1-1 福岡県公債	0.0290	200,000	193,924	2029/06/21
	1 大阪府20年	2.1900	200,000	216,032	2029/09/14
	199 共同発行地方	0.0500	100,000	96,806	2029/10/25
	13 神奈川県20年	2.2100	100,000	108,474	2029/12/20
	1-2 岡山県公債	0.1410	100,000	97,095	2030/01/31
	10兵庫県公債20年	2.2400	100,000	108,859	2030/02/22
	22-8 愛知県20年	1.8910	200,000	214,473	2030/09/13
	9 千葉県20年	1.8400	200,000	213,943	2030/10/11
	2-7 札幌市公債	0.1150	100,000	96,037	2030/12/20
	94 川崎市公債	0.1050	100,000	95,013	2031/09/19
	2 埼玉県公債	0.7060	300,000	293,045	2033/05/20

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
	1 東京都30年	2.2100	100,000	110,590	2033/06/20
	1 京都市30年	2.5700	100,000	113,908	2037/09/18
	8 東京都30年	2.2300	400,000	436,870	2038/09/17
	13 東京都30年	1.9300	500,000	511,540	2042/03/19
	7 静岡県30年	1.9880	100,000	102,189	2043/06/19
	1-3 福岡県30年	0.4320	100,000	67,740	2049/06/18
	小 計	—	8,800,000	8,907,510	—
特 殊 債 券 (除く金融債券)	64 地方公共団体	0.5740	100,000	100,078	2024/09/27
	227 政保道路機構	0.5440	200,000	200,293	2024/09/30
	231 政保道路機構	0.4950	300,000	300,502	2024/11/29
	67政保地方公共団	0.4660	100,000	100,167	2024/12/13
	76政保地方公共団	0.4250	300,000	300,588	2025/09/12
	15 公営企業20年	2.1500	100,000	102,213	2025/09/24
	85 中日本高速道	0.0700	300,000	298,589	2025/10/21
	17 公営企業20年	2.3900	100,000	103,278	2026/03/24
	85 地方公共団体	0.0800	100,000	98,902	2026/06/26
	29 地方公共団体5年	0.0050	300,000	296,029	2026/07/28
	288 政保道路機構	0.0100	189,000	187,133	2026/09/30
	93 住宅支援機構	1.5570	100,000	102,587	2026/12/18
	F96 地方公共団体	1.5460	100,000	102,381	2027/01/29
	20 公営企業20年	2.2500	100,000	104,444	2027/03/24
	36 日本政策投資B	2.2300	100,000	104,943	2027/05/28
	22 公営企業20年	2.3200	100,000	104,985	2027/06/18
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	102,165	2027/08/25
	27 道路機構	2.3400	100,000	105,888	2027/10/20
	101 地方公共団体	0.2350	100,000	98,455	2027/10/28
	124 住宅支援機構	1.4280	100,000	102,891	2027/12/20
	226 住宅支援機構	0.2400	100,000	98,701	2027/12/20
	33 政保中部空港	0.2600	200,000	198,000	2028/03/17
	106 地方公共団体	0.2150	200,000	196,102	2028/03/28
	24 公営企業20年	2.2900	200,000	211,972	2028/04/25
	37 道路機構	2.4200	300,000	321,313	2028/06/20
	74 政保道路機構	1.9000	100,000	105,870	2029/01/30
	89 都市再生	1.1020	100,000	101,733	2029/02/20
	47 道路機構	2.4100	200,000	216,092	2029/04/20
	79 政保道路機構	2.1000	200,000	214,157	2029/04/27
	2 地方公営20年	2.2900	100,000	107,000	2029/04/27
	81 政保道路機構	2.1000	200,000	214,437	2029/05/31
	135 道路機構	0.9390	200,000	202,032	2029/06/20
	93 都市再生	1.1020	100,000	101,822	2029/06/20
	47日本政策投資C0	1.0270	100,000	101,468	2029/09/20
	90 政保道路機構	2.1000	500,000	538,136	2029/09/28
	4 地方公共団20年	2.1200	100,000	106,898	2029/12/28
	99 政保道路機構	2.2000	100,000	108,585	2030/01/31
	10 日本政策金融	2.1670	100,000	107,944	2030/03/19
	124 日本政策投資	0.1550	100,000	96,433	2030/04/16
	52 住宅支援機構	2.0100	100,000	107,222	2030/07/16
	117 都市再生	0.8040	100,000	99,842	2030/11/20
	127 政保道路機構	2.0000	200,000	216,372	2031/01/31

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
	18 地方公共団20	1.7810	300,000	316,384	2031/10/28
	9 道路債券	2.9000	100,000	114,622	2032/05/20
	176 政保道路機構	1.6450	100,000	105,893	2032/10/29
	130 住宅支援機構	1.7630	200,000	211,774	2032/12/20
	196 政保道路機構	1.7790	100,000	106,897	2033/07/29
	210 政保道路機構	1.5470	200,000	209,232	2034/01/31
	88 政保道路機構	2.3000	100,000	109,935	2039/08/31
	S11 住宅機構RMBS	2.1200	10,379	10,431	2040/05/10
	19 住宅機構RMBS	2.1500	12,675	13,009	2043/11/10
	24 住宅機構RMBS	2.3400	25,446	26,196	2044/05/10
	26 住宅機構RMBS	2.1400	39,537	40,762	2044/07/10
	27 住宅機構RMBS	2.0500	14,203	14,674	2044/08/10
	28 住宅機構RMBS	1.9800	16,593	17,243	2044/09/10
	29 住宅機構RMBS	1.9500	17,886	18,603	2044/10/10
	30 住宅機構RMBS	1.9700	17,496	18,197	2044/11/10
	32 住宅機構RMBS	1.8200	34,512	35,688	2045/01/10
	35 住宅機構RMBS	1.8700	17,608	18,257	2045/04/10
	36 住宅機構RMBS	1.8100	16,781	17,344	2045/05/10
	43 住宅機構RMBS	1.6000	21,889	22,484	2045/12/10
	46 住宅機構RMBS	1.8500	16,769	17,324	2046/03/10
	48 住宅機構RMBS	1.8900	31,856	32,904	2046/05/10
	49 住宅機構RMBS	1.7600	16,288	16,770	2046/06/10
	51 住宅機構RMBS	1.6400	35,550	36,538	2046/08/10
	55 住宅機構RMBS	1.4100	47,590	48,484	2046/12/10
	18 道路機構	2.8700	100,000	114,507	2046/12/20
	57 住宅機構RMBS	1.4400	22,782	23,246	2047/02/10
	58 住宅機構RMBS	1.4000	25,431	25,898	2047/03/10
	22 道路機構	2.6700	300,000	332,321	2047/03/20
	59 住宅機構RMBS	1.4400	48,388	49,384	2047/04/10
	60 住宅機構RMBS	1.3400	73,173	74,351	2047/05/10
	61 住宅機構RMBS	1.2600	24,733	25,037	2047/06/10
	67 住宅機構RMBS	1.0900	31,783	31,735	2047/12/10
	69 住宅機構RMBS	1.2800	66,468	66,986	2048/02/10
	70 住宅機構RMBS	1.2500	57,418	58,038	2048/03/10
	73 住宅機構RMBS	1.3000	32,628	32,951	2048/06/10
	99 住宅機構RMBS	0.8800	51,561	50,302	2050/08/10
	123 住宅機構RMBS	0.4600	69,050	64,644	2052/08/10
	124 住宅機構RMBS	0.4200	68,534	63,962	2052/09/10
	125 住宅機構RMBS	0.4200	68,313	63,763	2052/10/10
	127 住宅機構RMBS	0.4000	70,652	65,685	2052/12/10
	128 住宅機構RMBS	0.4200	69,151	64,462	2053/01/10
	129 住宅機構RMBS	0.4600	71,029	66,284	2053/02/10
	137 住宅機構RMBS	0.4700	73,345	68,225	2053/10/10
	167 住宅機構RMBS	0.4100	85,555	78,205	2056/04/10
	183 住宅機構RMBS	0.5300	183,272	169,819	2057/08/10
	186 住宅機構RMBS	0.7400	93,233	88,030	2057/11/10
	198 住宅機構RMBS	1.1800	195,288	192,339	2058/11/10
	小 計	-	9,963,845	10,238,499	-
普通社債券	23 西日本高速道	0.6020	100,000	100,017	2024/06/20

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
	1 みずほFG劣後	0.9500	100,000	100,056	2024/07/16
	1 三井住友FG劣後	0.8490	100,000	100,097	2024/09/12
	64 阪急阪神HLDG	0.1000	100,000	98,718	2026/12/08
	86 東日本高速道	0.0400	200,000	197,397	2026/12/18
	73 ホンダファイナンス	0.1000	200,000	197,441	2026/12/18
	553 中部電力	0.2500	200,000	197,973	2027/02/25
	2 三菱HCキャピタル	0.1900	200,000	197,194	2027/03/01
	63 三井物産	2.3700	100,000	104,969	2027/04/23
	9 みずほ銀行劣後	2.5200	100,000	104,609	2027/04/27
	8 住友信託 劣後	2.4900	100,000	104,432	2027/05/10
	550 関西電力	0.3900	300,000	297,364	2027/05/25
	13 大和ハウス	0.2850	100,000	98,801	2027/06/01
	17 アサヒグループHD	0.2900	200,000	197,626	2027/06/01
	207 オリックス	0.3500	200,000	197,706	2027/06/15
	30 東レ	0.3750	100,000	98,918	2027/07/16
	8 みずほコーポレート	2.5400	100,000	105,770	2027/07/27
	56 東京電力PG	0.9800	200,000	200,150	2027/10/19
	31 KDDI	0.4300	200,000	197,985	2027/10/27
	38 京王電鉄	0.2950	100,000	98,722	2027/11/29
	17 NTTファイナンス	0.2800	200,000	197,008	2027/12/20
	24三菱ケミカルホールデイ	0.3700	100,000	98,369	2028/02/25
	7 ファーストリテイリング	0.4050	100,000	98,433	2028/06/06
	16 小松製作所	0.3350	100,000	98,196	2028/07/13
	101 トヨタファイナンス	0.5930	200,000	198,514	2028/10/13
	9 TDK	0.2600	100,000	96,799	2028/12/01
	84 西日本高速道	0.4940	200,000	197,841	2028/12/07
	15 九州旅客鉄道	0.6030	200,000	196,922	2028/12/11
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	106,102	2029/01/29
	42 東海旅客鉄道	2.3120	100,000	107,041	2029/04/24
	508 東北電力	0.4650	200,000	195,695	2029/04/25
	87 西日本高速道	0.7150	200,000	199,323	2029/05/23
	547 東北電力	0.5000	100,000	97,922	2029/06/25
	32 住友電工	0.4640	100,000	97,923	2029/07/13
	12 旭化成	0.2100	200,000	193,286	2029/09/06
	60 西日本旅客鉄	0.2550	200,000	192,821	2030/05/21
	45 東京地下鉄	0.2150	100,000	95,851	2030/09/18
	22 日立製作所	0.8650	100,000	99,321	2030/12/13
	41 大阪瓦斯	0.2200	200,000	189,558	2031/06/03
	135 三菱地所	0.2600	200,000	188,936	2031/06/20
	169 東日本旅客鉄	0.1650	200,000	188,753	2031/07/15
	546 中部電力	0.2800	200,000	188,553	2031/09/25
	496 九州電力	0.3300	300,000	282,083	2031/10/24
	10 東急	0.2400	100,000	93,681	2031/12/09
	58 三菱地所	2.9000	100,000	113,076	2032/05/20
	66 東京電力PG	1.2400	100,000	96,711	2033/07/13
	560 関西電力	1.3660	200,000	199,857	2033/11/25
	110東日本旅客鉄	1.7600	100,000	93,943	2045/07/28
	小 計	-	7,300,000	7,198,481	-
	合 計	-	136,555,845	131,342,083	-

■ 投資信託財産の構成

(2024年5月27日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	131,342,083	99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	772,089	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	132,114,172	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年5月27日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	132,114,172,877円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	447,146,728
公 社 債 (評 価 額)	131,342,083,431
未 収 利 息	315,893,912
前 払 費 用	9,048,806
(B) 負 債	9,709,999
未 払 解 約 金	9,709,999
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	132,104,462,878
元 本	111,534,529,015
次 期 繰 越 損 益 金	20,569,933,863
(D) 受 益 権 総 口 数	111,534,529,015口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	11,844円

※当期における期首元本額102,269,168,472円、期中追加設定元本額29,628,827,372円、期中一部解約元本額20,363,466,829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2023年5月26日 至2024年5月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,131,305,226円
受 取 利 息	1,131,539,003
支 払 利 息	△ 233,777
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 7,100,187,505
売 買 益	38,479,369
売 買 損	△ 7,138,666,874
(C) そ の 他 費 用 等	△ 17,845
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 5,968,900,124
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	24,606,847,723
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 4,513,824,876
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,445,811,140
(H) 合 計 (D + E + F + G)	20,569,933,863
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	20,569,933,863

※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)	10,086,392,456円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3 (安定成長型)	191,777,339円
三井住友・DC年金バランス50 (標準型)	16,185,650,259円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)	74,487,672円
三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)	4,312,595,901円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)	6,962,315円
SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	968,819,398円	SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,013,928,932円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020 (4資産タイプ)	43,274,486円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	8,323,855,142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)	171,465,996円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,894,680,399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)	645,540,263円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,414,508,839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)	1,371,276,317円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	316,393,567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)	784,738,825円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	518,203,029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)	906,711,591円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	274,074,334円
三井住友・DC年金バランスゼロ (債券型)	130,033,879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>	118,270,332円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	815,309,218円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,732,178,254円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	240,763,225円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,201,314,761円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	11,033,505円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,140,490,805円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	165,234,807円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,502,645,896円
三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型)	5,316,473,997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)	860,595,225円
三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型)	1,879,620,743円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	370,979,799円
三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型)	3,194,454,017円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	448,136,826円
三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型)	772,851,214円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	176,478,873円
三井住友・資産最適化ファンド (5成長重視型)	85,283,917円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	53,193,797円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	365,728,224円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,121,752,777円
三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型)	440,296,135円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,953,514,634円
三井住友DS・年金バランス50 (標準型)	978,131,960円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	556,806,191円
三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型)	333,004,020円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	224,885,881円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	12,889,468円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	25,746,829円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	175,450,276円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	247,874,507円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	75,276,359円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,568,708,466円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	53,827,102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>	1,340,997,860円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	9,933,484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>	717,421,682円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	4,305,450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>	1,144,020,607円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1 (保守型)	9,567,445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>	932,406,801円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)	70,874,663円	三井住友・ニュー・アジア・ファンド (リスク3%)<適格機関投資家限定>	450,428,044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21期（2023年8月26日から2024年8月26日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年10月3日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ換算ベース）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） F T S E 世界国債 インデックス （除く日本、円ヘッジ 換算ベース）		公組 入比	社 債率	純 資 産 額
	騰	落	騰	落			
	円	%		%	%		百万円
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
20期(2023年8月25日)	12,197	△7.7	339.19	△7.6	100.4		18,975
21期(2024年8月26日)	12,332	1.1	343.60	1.3	96.0		34,774

※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

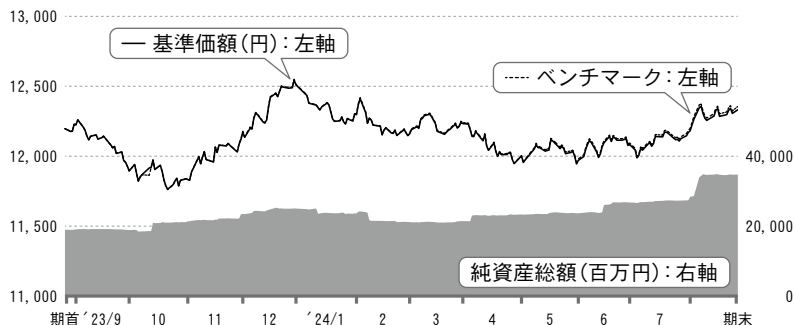
年月日	基準価額		（ベンチマーク） F T S E 世界国債 インデックス （除く日本、円ヘッジ 換算ベース）		公組 入比	社 債率
	騰	落	騰	落		
(期首) 2023年8月25日	円	%		%	%	
8月末	12,197	—	339.19	—	100.4	
9月末	12,224	0.2	339.97	0.2	101.1	
10月末	11,895	△2.5	330.75	△2.5	100.1	
11月末	11,833	△3.0	329.05	△3.0	97.4	
12月末	12,172	△0.2	338.66	△0.2	97.8	
2024年1月末	12,510	2.6	347.97	2.6	96.2	
2月末	12,297	0.8	342.04	0.8	102.7	
3月末	12,160	△0.3	338.30	△0.3	101.8	
4月末	12,233	0.3	340.37	0.3	97.7	
5月末	12,002	△1.6	333.82	△1.6	101.9	
6月末	11,970	△1.9	333.17	△1.8	98.3	
7月末	12,083	△0.9	336.31	△0.8	100.2	
(期末) 2024年8月26日	12,182	△0.1	339.24	0.0	94.1	
	12,332	1.1	343.60	1.3	96.0	

※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（2023年8月26日から2024年8月26日まで）

基準価額等の推移



期首	12,197円
期末	12,332円
騰落率	+1.1%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ換算ベース）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（2023年8月26日から2024年8月26日まで）

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

上昇要因

- ・主要国の中銀による利下げ実施や、利下げの織り込みが進展したことを背景に米欧金利が低下（債券価格は上昇）したこと

▶ 投資環境について（2023年8月26日から2024年8月26日まで）

債券市場は米国、欧州ともに上昇しました。

債券市場

米国や欧州の長期金利（10年国債利回り）は低下しました。

主要な国や地域で中銀の金融政策サイクルが利上げから利下げへ転換する可能性が意識されたことが金利低下要因となりました。また、ECB（欧州中央銀行）やBOE（イングランド銀行、中央銀行）などが利下げを実施したことや、FRB（米連邦準備制度理事会）の利下げの織り込みが進展したことも金利低下要因となりました。

▶ ポートフォリオについて（2023年8月26日から2024年8月26日まで）

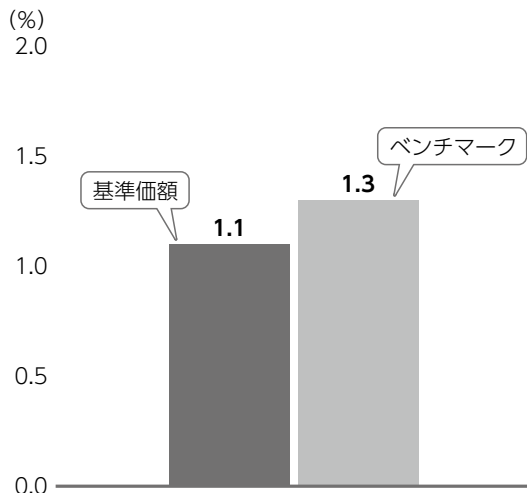
債券組入比率

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ換算ベース）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。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、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（2023年8月26日から2024年8月26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、円ヘッジ換算ベース）をベンチマークとしています。

記載のグラフは、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+1.1%となり、ベンチマークの騰落率+1.3%を0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・信託報酬やキャッシュフローに伴うポートフォリオ維持のための売買コスト等の費用が生じたため

2 今後の運用方針

米欧では中央銀行がインフレ抑制と景気下支えの両面を意識する難しい舵取りが続くと予想されますが、今後は累積した利上げの効果による景気減速のリスクと海外中銀の利下げが意識されることから、金利は緩やかに低下する展開を予想します。

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、外貨建資産については、原則として対円で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 (2023年8月26日から2024年8月26日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) そ の 他 費 用	9円	0.074%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
（ 保 管 費 用 ）	(9)	(0.073)	
（ そ の 他 ）	(0)	(0.001)	
合 計	9	0.074	

期中の平均基準価額は12,138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 (2023年8月26日から2024年8月26日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル 77,491	千アメリカ・ドル 35,785
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 4,365	千カナダ・ドル 1,865
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 3,043	千オーストラリア・ドル 1,588
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 1,636	千シンガポール・ドル 662
	ニュージーランド	国 債 証 券	千ニュージーランド・ドル 539	千ニュージーランド・ドル 149
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 6,333	千イギリス・ポンド 2,261
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シュケル 1,660	千イスラエル・シュケル 419
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 2,050	千デンマーク・クローネ 1,110
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 2,559	千ノルウェー・クローネ 999
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 2,204	千スウェーデン・クローナ 1,354
	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 20,412	千メキシコ・ペソ 10,400
	中 国	国 債 証 券	千オフショア・人民元 134,885	千オフショア・人民元 24,555
	ポーランド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 3,420	千ポーランド・ズロチ 1,578
	国	ユ ー ロ		千ユーロ
アイルランド		国 債 証 券	502	296
オランダ		国 債 証 券	1,879	894
ベルギー		国 債 証 券	2,346	1,257
フランス		国 債 証 券	10,726	5,182
ドイツ		国 債 証 券	8,971	4,425
スペイン		国 債 証 券	6,602	3,414
イタリア		国 債 証 券	9,417	4,598
フィンランド		国 債 証 券	536	178
オーストリア		国 債 証 券	1,301	473

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

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 (2023年8月26日から2024年8月26日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年8月26日から2024年8月26日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2024年8月26日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	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	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
		千円	千円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 114,580	千アメリカ・ドル 108,969	15,643,683	45.0	—	19.1	16.6	9.3
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 6,540	千カナダ・ドル 6,284	668,176	1.9	—	1.0	0.4	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 5,070	千オーストラリア・ドル 4,544	443,128	1.3	—	0.9	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 2,780	千シンガポール・ドル 2,779	306,920	0.9	—	0.6	0.2	0.1
ニュージーランド	千ニューージーランド・ドル 1,060	千ニューージーランド・ドル 935	83,675	0.2	—	0.1	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 11,100	千イギリス・ポンド 9,539	1,810,238	5.2	—	3.7	1.2	0.4
イスラエル	千イスラエル・シケル 3,210	千イスラエル・シケル 2,704	105,312	0.3	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 4,120	千デンマーク・クローネ 4,024	86,720	0.2	—	0.2	0.0	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 4,190	千ノルウェー・クローネ 3,991	54,846	0.2	—	0.1	0.0	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 3,850	千スウェーデン・クローナ 3,792	53,399	0.2	—	0.1	0.1	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 36,120	千メキシコ・ペソ 32,530	243,127	0.7	—	0.4	0.3	0.1
中 国	千オフショア・人民元 165,900	千オフショア・人民元 171,881	3,469,399	10.0	—	4.1	3.7	2.2
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 5,000	千ポーランド・ズロチ 4,689	176,724	0.5	—	0.2	0.3	0.0
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
アイルランド	1,090	980	157,641	0.5	—	0.3	0.1	0.0
オランダ	3,190	2,898	466,001	1.3	—	0.8	0.4	0.1
ベルギー	3,780	3,433	551,906	1.6	—	1.1	0.4	0.1
フランス	17,520	15,936	2,561,874	7.4	—	4.2	2.7	0.5
ドイツ	13,440	12,829	2,062,470	5.9	—	3.2	1.9	0.9
スペイン	10,250	9,527	1,531,639	4.4	—	2.4	1.6	0.4
イタリア	14,840	14,560	2,340,803	6.7	—	3.8	2.0	0.9
フィンランド	1,190	1,040	167,214	0.5	—	0.3	0.1	0.0
オーストリア	2,650	2,376	381,996	1.1	—	0.7	0.3	0.1
合 計	—	—	33,366,903	96.0	—	47.4	32.9	15.6

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示
外国(外貨建)公社債

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	2.8750	290	240	34,465	2043/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	230	212	30,524	2043/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	300	266	38,202	2044/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	270	248	35,735	2044/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	320	272	39,175	2044/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	220	183	26,334	2044/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	220	168	24,134	2045/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	290	240	34,596	2045/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	110	89	12,831	2045/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	220	166	23,875	2046/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	120	115	16,555	2026/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	230	173	24,888	2046/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	250	178	25,696	2046/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	490	470	67,610	2026/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	300	245	35,258	2047/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	250	195	28,009	2047/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	250	194	27,950	2047/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	420	406	58,410	2028/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	360	292	42,059	2048/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	420	348	50,102	2048/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	300	295	42,476	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	300	290	41,763	2028/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	500	405	58,214	2048/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	620	611	87,774	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	100	97	14,038	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	300	259	37,321	2048/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	110	107	15,478	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	230	225	32,344	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	370	299	43,020	2049/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	700	680	97,737	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	50	48	6,990	2026/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	100	94	13,559	2029/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	590	466	66,934	2049/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	320	310	44,509	2026/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	200	192	27,665	2026/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	220	200	28,715	2029/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	240	228	32,785	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	110	105	15,082	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	180	128	18,402	2049/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	350	333	47,853	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	570	508	73,021	2030/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	570	372	53,437	2050/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	30	28	4,035	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	120	110	15,893	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	500	421	60,510	2030/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	500	268	38,535	2050/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	630	414	59,503	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	80	73	10,513	2027/05/31

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	
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	310	283	40,637	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	350	336	48,367	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	100	90	13,028	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	750	627	90,143	2030/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	450	248	35,733	2050/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	210	136	19,662	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	340	309	44,365	2027/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	590	566	81,269	2025/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	290	277	39,843	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	470	424	60,939	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	710	600	86,144	2030/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	140	82	11,871	2050/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	530	453	65,071	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	390	245	35,252	2051/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	570	540	77,617	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	460	416	59,802	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	510	486	69,797	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	500	475	68,263	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	730	661	94,944	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	350	316	45,405	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	540	494	70,981	2028/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	450	303	43,630	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	320	233	33,542	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	550	521	74,855	2026/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	400	361	51,930	2027/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	420	400	57,540	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	530	503	72,253	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	460	422	60,618	2028/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	230	201	28,955	2031/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	500	473	68,018	2026/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	590	418	60,012	2051/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	720	659	94,707	2028/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	220	169	24,381	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	2,010	1,900	272,835	2026/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	390	368	52,959	2026/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	330	301	43,237	2028/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	580	530	76,141	2028/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	920	781	112,221	2031/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	650	588	84,441	2028/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	460	297	42,769	2051/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	810	572	82,152	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	710	666	95,753	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	460	432	62,054	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	570	517	74,283	2028/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	540	507	72,916	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	470	294	42,278	2051/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,040	886	127,238	2031/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	130	122	17,607	2026/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	420	396	56,957	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	500	455	65,395	2028/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	170	124	17,910	2041/11/15

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		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	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	380	347	49,886	2028/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	850	801	115,127	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	510	463	66,482	2028/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,050	923	132,595	2032/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	450	414	59,543	2029/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	200	155	22,285	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	300	206	29,575	2052/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	480	444	63,779	2029/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	530	505	72,632	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	90	85	12,214	2029/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	100	96	13,864	2029/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	850	800	114,977	2032/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,140	1,110	159,470	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	370	327	46,997	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	520	409	58,826	2052/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	180	174	25,080	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,000	959	137,788	2029/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	100	98	14,169	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	660	647	92,973	2029/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	980	913	131,086	2032/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	350	340	48,875	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	430	422	60,674	2027/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	220	209	30,105	2029/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	330	296	42,581	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	360	291	41,820	2052/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	220	214	30,800	2029/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	380	384	55,218	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	200	201	28,978	2029/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	730	749	107,543	2032/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	400	401	57,603	2025/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	470	475	68,276	2027/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	410	411	59,130	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	300	304	43,716	2029/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	340	343	49,273	2029/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	300	293	42,187	2042/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	380	371	53,355	2052/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	300	299	42,971	2025/12/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	390	388	55,800	2026/01/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	260	261	37,522	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	620	625	89,855	2029/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	1,020	999	143,553	2033/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	980	973	139,729	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	640	639	91,786	2026/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	500	495	71,126	2030/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	450	432	62,109	2043/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	700	640	91,965	2053/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	770	782	112,276	2030/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	600	605	86,958	2028/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	900	907	130,311	2026/03/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	440	438	62,902	2026/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	730	728	104,537	2028/03/31

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	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	940	936	134,507	2030/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	720	698	100,235	2033/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	830	824	118,427	2026/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	800	794	114,046	2028/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	400	398	57,275	2028/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	500	495	71,102	2030/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	370	355	50,965	2043/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	530	485	69,662	2053/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	900	902	129,572	2026/06/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	370	374	53,693	2028/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.7500	170	170	24,485	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	750	757	108,767	2026/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	170	172	24,788	2028/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	800	804	115,538	2033/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	500	504	72,427	2026/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	600	615	88,330	2043/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	930	931	133,672	2053/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	900	913	131,086	2026/09/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	900	922	132,488	2028/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	470	486	69,851	2028/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.8750	900	941	135,103	2028/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	530	556	79,902	2030/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	960	1,011	145,273	2033/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	900	914	131,338	2026/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.7500	980	1,055	151,465	2043/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.7500	630	699	100,412	2053/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.8750	550	554	79,591	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	600	607	87,170	2026/12/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	800	802	115,182	2028/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	600	600	86,240	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	580	581	83,422	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	1,190	1,195	171,562	2027/01/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	890	901	129,481	2029/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	150	150	21,590	2030/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	1,300	1,319	189,470	2034/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	1,290	1,320	189,516	2054/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	750	755	108,497	2027/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	670	681	97,800	2031/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	500	520	74,740	2044/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	750	773	111,052	2031/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	500	503	72,347	2026/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	750	758	108,928	2027/03/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	600	614	88,267	2029/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	1,000	1,006	144,549	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	1,200	1,221	175,386	2027/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	700	713	102,444	2029/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	700	717	102,949	2031/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	1,200	1,264	181,581	2031/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	900	937	134,523	2029/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	1,010	1,056	151,643	2034/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.8750	1,000	1,013	145,541	2026/04/30

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	
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	800	815	117,001	2027/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	700	740	106,293	2044/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	1,300	1,416	203,306	2054/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	600	632	90,805	2031/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.8750	700	710	101,995	2026/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	570	583	83,746	2027/06/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	520	539	77,418	2029/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	700	708	101,684	2026/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	500	504	72,389	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	600	610	87,626	2027/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	750	769	110,479	2029/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	700	711	102,073	2029/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	500	516	74,157	2031/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	600	615	88,349	2031/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	50	53	7,689	2036/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	50	47	6,856	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	70	72	10,396	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	80	83	12,027	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	100	107	15,454	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	140	146	21,036	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	40	39	5,657	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	140	144	20,685	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	210	184	26,519	2041/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	150	131	18,846	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	230	188	27,091	2042/08/15
小	計		-	114,580	108,969	15,643,683	-
カ ナ ダ	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.0000	210	252	26,833	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	90	95	10,122	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	30	28	2,987	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	20	19	2,063	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	140	132	14,127	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	240	190	20,219	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	60	58	6,174	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	60	58	6,216	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	150	136	14,550	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	180	174	18,543	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	220	189	20,182	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	70	66	7,103	2026/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	290	264	28,116	2031/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	350	258	27,434	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	390	373	39,669	2027/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	60	54	5,774	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	310	301	32,049	2029/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	400	373	39,674	2032/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	10	9	1,056	2027/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	280	278	29,585	2025/10/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	110	106	11,287	2032/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	230	234	24,889	2028/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	200	198	21,143	2026/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	670	657	69,926	2033/06/01

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		
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	460	465	49,469	2028/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	210	194	20,674	2055/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5000	250	252	26,863	2025/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0000	120	125	13,332	2029/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	150	156	16,619	2034/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0000	460	466	49,607	2026/08/01	
	CANADA GOVERNMENT	国債証券	2.7500	120	111	11,876	2064/12/01	
小	計		-	6,540	6,284	668,176	-	
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7500	80	82	8,036	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	130	128	12,496	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2500	130	131	12,795	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	90	87	8,528	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	50	44	4,358	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	220	214	20,942	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	210	167	16,337	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	380	368	35,896	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	191	18,702	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	190	155	15,182	2041/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	190	164	16,036	2031/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	400	331	32,332	2032/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	560	475	46,343	2030/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	230	133	12,982	2051/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	200	191	18,669	2025/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	240	197	19,304	2031/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	380	356	34,798	2026/09/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	170	16,618	2032/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	370	344	33,580	2033/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	150	147	14,429	2034/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	370	356	34,738	2034/12/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2500	100	102	10,018	2034/06/21		
小	計		-	5,070	4,544	443,128	-	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	440	444	49,099	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	760	798	88,198	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	150	151	16,705	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	40	39	4,362	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	190	187	20,760	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	250	237	26,227	2036/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	200	199	22,063	2028/05/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	170	161	17,886	2039/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	140	116	12,816	2050/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	40	38	4,292	2025/11/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	30	24	2,714	2051/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	100	96	10,709	2026/11/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	80	83	9,189	2072/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	110	111	12,325	2029/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	80	86	9,569	2054/06/01	
	小	計		-	2,780	2,779	306,920	-
	ニュージーランド	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	4.5000	110	111	10,002	2027/04/15

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	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	80	67	6,009	2037/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	1.7500	110	73	6,614	2041/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	0.2500	210	184	16,483	2028/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	30	21	1,915	2051/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	0.5000	70	65	5,894	2026/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.0000	320	275	24,665	2032/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	4.5000	80	82	7,367	2030/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	5.0000	50	52	4,722	2054/05/15
小	計		—	1,060	935	83,675	—
イギリス	UK GILT	国債証券	6.0000	100	108	20,665	2028/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	140	144	27,427	2032/06/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	180	184	34,924	2036/03/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	410	436	82,824	2038/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	80	81	15,387	2027/12/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	50	51	9,709	2042/12/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	110	116	22,037	2030/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	90	87	16,640	2049/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	80	80	15,264	2039/09/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	30	31	5,960	2034/09/07
	UK GILT	国債証券	4.0000	110	102	19,385	2060/01/22
	UK GILT	国債証券	3.7500	40	35	6,774	2052/07/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	90	77	14,622	2044/01/22
	UK GILT	国債証券	3.5000	140	117	22,245	2068/07/22
	UK GILT	国債証券	3.5000	120	105	20,097	2045/01/22
	UK GILT	国債証券	2.0000	30	29	5,561	2025/09/07
	UK GILT	国債証券	2.5000	120	78	14,826	2065/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	240	229	43,533	2026/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	110	64	12,227	2047/07/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	170	130	24,783	2037/09/07
	UK GILT	国債証券	1.7500	120	65	12,487	2057/07/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	130	120	22,959	2027/07/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	70	64	12,233	2028/10/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	130	62	11,768	2071/10/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	90	54	10,374	2049/01/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	160	139	26,416	2029/10/22
	UK GILT	国債証券	0.3750	350	286	54,410	2030/10/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	590	375	71,268	2041/10/22
	UK GILT	国債証券	0.5000	140	44	8,420	2061/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	260	110	20,906	2050/10/22
	UK GILT	国債証券	0.1250	320	304	57,756	2026/01/30
	UK GILT	国債証券	0.1250	50	44	8,410	2028/01/31
	UK GILT	国債証券	0.6250	70	49	9,386	2035/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	120	94	17,992	2031/07/31
	UK GILT	国債証券	0.3750	270	250	47,572	2026/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	550	285	54,090	2046/01/31
	UK GILT	国債証券	1.2500	90	45	8,660	2051/07/31
	UK GILT	国債証券	0.5000	600	521	99,025	2029/01/31
	UK GILT	国債証券	1.5000	20	10	2,006	2053/07/31
	UK GILT	国債証券	1.0000	170	139	26,497	2032/01/31
	UK GILT	国債証券	1.1250	90	34	6,544	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 GILT	国債証券	4.1250	80	80	15,201	2027/01/29
	UK GILT	国債証券	3.7500	450	434	82,360	2038/01/29
	UK GILT	国債証券	3.5000	100	98	18,784	2025/10/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	650	622	118,071	2033/01/31
	UK GILT	国債証券	3.7500	380	337	64,020	2053/10/22
	UK GILT	国債証券	4.0000	350	323	61,481	2063/10/22
	UK GILT	国債証券	4.5000	160	163	31,002	2028/06/07
	UK GILT	国債証券	4.6250	560	591	112,221	2034/01/31
	UK GILT	国債証券	4.7500	340	357	67,824	2043/10/22
	UK GILT	国債証券	3.7500	520	516	97,945	2027/03/07
	UK GILT	国債証券	4.3750	260	256	48,747	2054/07/31
	UK GILT	国債証券	4.1250	230	232	44,169	2029/07/22
	UK TSY GILT	国債証券	1.1250	190	128	24,318	2039/01/31
小	計		—	11,100	9,539	1,810,238	—
イスラエル	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.7500	150	146	5,704	2025/08/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	230	185	7,231	2047/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.0000	260	245	9,548	2027/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.2500	110	114	4,457	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.2500	480	440	17,163	2028/09/28
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.0000	320	264	10,299	2030/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	440	297	11,589	2037/05/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.5000	290	274	10,686	2026/02/27
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.3000	500	391	15,263	2032/04/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.8000	220	139	5,439	2052/11/29
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	210	203	7,929	2029/02/28
小	計		—	3,210	2,704	105,312	—
デンマーク	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5000	910	1,152	24,827	2039/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.7500	340	337	7,268	2025/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	570	542	11,682	2027/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	820	757	16,318	2029/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.2500	390	222	4,789	2052/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.0000	590	509	10,971	2031/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	2.2500	500	504	10,862	2033/11/15
小	計		—	4,120	4,024	86,720	—
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	370	359	4,935	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	570	550	7,563	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	620	596	8,194	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	170	159	2,185	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.3750	680	614	8,447	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	390	342	4,707	2031/09/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	185	2,544	2032/05/18
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	810	793	10,902	2033/08/15
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	310	318	4,379	2042/10/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6250	70	71	986	2034/04/13
小	計		—	4,190	3,991	54,846	—
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	3.5000	330	389	5,485	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.2500	340	349	4,919	2032/06/01

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	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.0000	460	451	6,356	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	1,060	1,022	14,393	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	600	569	8,017	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	400	357	5,034	2031/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.7500	660	652	9,193	2033/11/11
小	計		—	3,850	3,792	53,399	—
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
	MEX BONOS DE DESARROLLO	国債証券	7.5000	2,800	2,653	19,828	2027/06/03
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	3,500	3,351	25,045	2029/05/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	1,900	1,705	12,743	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	5,200	4,721	35,291	2031/05/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	2,500	2,033	15,198	2042/11/13
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	920	804	6,014	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.7500	3,300	3,094	23,126	2026/03/05
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	3,100	2,550	19,061	2047/11/07
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.5000	3,100	2,810	21,006	2027/03/04
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.5000	3,300	2,872	21,470	2033/05/26
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.0000	1,000	945	7,069	2026/09/03
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	3,500	3,069	22,942	2035/05/24
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	2,000	1,917	14,327	2029/03/01
小	計		—	36,120	32,530	243,127	—
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	1,200	1,224	24,706	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	3,500	3,650	73,687	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	2,000	2,163	43,678	2028/05/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7200	3,100	3,935	79,445	2051/04/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0200	2,800	2,978	60,124	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	6,800	6,931	139,901	2027/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	5,600	5,633	113,716	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	900	918	18,549	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,300	3,471	70,072	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	3,100	3,591	72,488	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	4,800	4,841	97,728	2025/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	2,800	2,923	59,000	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	5,400	5,547	111,984	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	3,600	3,643	73,533	2026/02/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	6,000	6,267	126,498	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	6,400	6,473	130,661	2026/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	10,500	10,948	220,998	2033/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	5,300	6,227	125,698	2053/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	1,900	1,965	39,676	2030/06/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	5,300	5,411	109,233	2028/07/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	6,000	6,056	122,255	2026/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	4,300	4,406	88,945	2028/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	5,400	5,581	112,658	2030/09/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,900	4,439	89,603	2053/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	8,200	8,383	169,217	2029/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9900	8,000	8,049	162,476	2026/03/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0400	10,400	10,477	211,492	2027/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	5,900	5,975	120,617	2031/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	4,700	4,786	96,611	2034/02/25

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	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	3,200	3,227	65,143	2029/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	8,300	8,335	168,255	2027/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2700	4,700	4,755	95,979	2034/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1200	2,500	2,511	50,699	2031/06/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9100	4,800	4,816	97,223	2029/07/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0300	1,300	1,329	26,835	2026/03/11
小	計		—	165,900	171,881	3,469,399	—
ポーランド	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	50	46	1,751	2028/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	240	224	8,476	2027/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	380	341	12,880	2029/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	820	656	24,753	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	520	472	17,788	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	270	212	8,016	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	580	563	21,239	2027/05/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	690	752	28,340	2028/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	180	189	7,153	2033/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	370	13,979	2026/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	140	136	5,151	2034/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	730	721	27,193	2029/07/25
	小	計		—	5,000	4,689	176,724
ユ ー ロ				千ユーロ	千ユーロ		
アイルランド	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.4000	80	80	12,864	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.0000	30	29	4,700	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.7000	60	53	8,548	2037/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.9000	170	161	25,940	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3500	40	37	6,020	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.1000	50	47	7,592	2029/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.5000	100	74	11,950	2050/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.2000	100	94	15,160	2027/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.2000	120	105	16,917	2030/10/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.0000	50	42	6,761	2031/10/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.3500	110	92	14,913	2032/10/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.0000	120	121	19,549	2043/10/18
	IRISH GOVT	国債証券	0.5500	60	41	6,721	2041/04/22
オランダ	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	4.0000	110	126	20,259	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	100	100	16,172	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.7500	80	81	13,048	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	100	96	15,522	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	190	181	29,238	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	150	141	22,742	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	60	54	8,742	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	340	248	39,881	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	340	297	47,747	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	230	217	34,995	2027/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	80	39	6,405	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	220	154	24,913	2038/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	330	298	48,001	2029/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	100	96	15,528	2026/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	40	34	5,566	2032/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.0000	120	103	16,697	2054/01/15

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	
ベルギー	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	310	311	50,036	2033/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.2500	290	314	50,500	2044/01/15
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	80	88	14,210	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5000	150	154	24,831	2026/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	130	142	22,867	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	100	107	17,317	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	140	143	23,000	2034/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9000	60	52	8,427	2038/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	40	38	6,260	2026/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6000	100	73	11,848	2047/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	270	258	41,524	2027/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4500	20	16	2,699	2037/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	220	207	33,343	2028/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.2500	50	44	7,188	2033/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9000	160	148	23,952	2029/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.7000	30	21	3,499	2050/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.1000	370	322	51,871	2030/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.4000	390	258	41,573	2040/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	150	139	22,376	2027/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.6500	30	13	2,116	2071/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	10	8	1,339	2031/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.3500	150	125	20,248	2032/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4000	200	129	20,814	2053/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.7500	320	308	49,639	2039/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	240	245	39,519	2033/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.4500	320	331	53,243	2043/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.5000	50	50	8,189	2055/06/22
フランス	FRANCE O. A. T.	国債証券	6.0000	180	186	29,979	2025/10/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.5000	340	382	61,512	2029/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.7500	140	170	27,337	2032/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.7500	100	116	18,717	2035/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	210	230	37,115	2038/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.5000	280	325	52,405	2041/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	60	66	10,762	2060/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.5000	240	243	39,125	2026/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	470	472	76,021	2027/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.2500	280	277	44,623	2045/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	210	208	33,568	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	200	195	31,474	2025/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	270	260	41,874	2026/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	20	16	2,660	2036/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	120	77	12,527	2066/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.2500	650	617	99,292	2026/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	160	134	21,548	2039/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	390	365	58,728	2028/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	110	94	15,268	2034/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	370	343	55,205	2028/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	230	156	25,209	2050/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	300	272	43,805	2029/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	540	472	75,950	2029/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	180	96	15,455	2052/05/25

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	
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	310	298	47,906	2026/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,130	961	154,517	2030/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	640	428	68,958	2040/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	80	30	4,915	2072/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	150	90	14,486	2044/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	630	519	83,580	2031/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	800	751	120,751	2027/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	890	722	116,196	2032/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	460	363	58,493	2038/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	950	893	143,664	2028/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	230	217	34,910	2032/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	940	835	134,334	2043/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	820	818	131,592	2026/09/24
	FRANCE OAT.	国債証券	3.0000	140	128	20,641	2054/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.0000	500	507	81,574	2033/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	670	674	108,431	2029/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.5000	450	473	76,124	2033/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	150	149	24,076	2027/09/24
	FRANCE OAT.	国債証券	3.0000	380	358	57,576	2049/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.2500	250	239	38,484	2055/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	450	452	72,755	2030/02/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	0.7500	450	234	37,731	2053/05/25
ド イ ツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.5000	90	100	16,158	2027/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.6250	160	177	28,572	2028/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	170	186	29,947	2028/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	130	156	25,211	2030/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.0000	140	164	26,454	2037/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.2500	90	110	17,725	2039/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	130	169	27,180	2040/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	330	330	53,171	2044/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	230	230	37,094	2046/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	100	97	15,629	2026/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	220	210	33,818	2026/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.2500	120	93	15,083	2048/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	100	94	15,220	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	100	93	14,969	2028/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	160	147	23,743	2029/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	250	225	36,296	2029/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	100	53	8,610	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	160	143	22,998	2030/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	140	110	17,710	2035/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	260	230	37,005	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	220	205	33,026	2027/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	110	97	15,659	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	350	306	49,294	2031/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	80	61	9,835	2036/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	170	91	14,671	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	310	284	45,688	2028/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	200	173	27,869	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	110	95	15,335	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	140	71	11,513	2052/08/15

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	190	162	26,167	2032/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	700	586	94,263	2038/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7000	180	174	28,073	2032/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.1000	220	219	35,325	2029/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.8000	390	337	54,233	2053/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.3000	390	394	63,449	2033/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.3000	260	263	42,313	2033/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.8000	150	129	20,898	2053/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.6000	250	258	41,618	2033/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.4000	150	152	24,487	2030/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.2000	480	480	77,242	2034/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	300	302	48,602	2054/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.6000	380	386	62,127	2041/05/15
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	3.1000	140	140	22,592	2025/09/18
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	2.5000	400	400	64,310	2026/03/19
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	2.9000	380	383	61,593	2026/06/18
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	2.7000	250	251	40,457	2026/09/17
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	100	97	15,622	2025/10/10
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	570	548	88,188	2026/04/10
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	410	390	62,831	2026/10/09
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	360	339	54,643	2027/04/16
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	1.3000	470	458	73,651	2027/10/15
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	1.3000	70	68	10,970	2027/10/15
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	2.2000	350	350	56,359	2028/04/13
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	2.4000	350	353	56,826	2028/10/19
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	2.1000	380	379	61,028	2029/04/12
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	2.5000	300	305	49,094	2029/10/11
スペイン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	6.0000	70	80	12,866	2029/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2000	400	291	46,911	2040/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.7500	70	84	13,607	2032/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.2000	130	143	23,129	2037/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.7000	50	58	9,380	2041/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	210	202	32,518	2030/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	180	178	28,624	2026/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	130	123	19,788	2066/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.5000	190	184	29,740	2027/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.3500	100	95	15,415	2033/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	180	174	27,999	2027/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	320	307	49,425	2028/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	290	277	44,667	2028/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	420	399	64,248	2029/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.8500	20	17	2,862	2035/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.6000	100	90	14,540	2029/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	510	453	72,952	2030/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	300	285	45,904	2027/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	40	22	3,677	2050/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2500	170	156	25,151	2030/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	300	288	46,414	2026/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.1000	310	261	42,045	2031/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	140	72	11,626	2071/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	450	412	66,376	2028/01/31

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	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8500	500	375	60,360	2037/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	200	171	27,540	2031/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	370	251	40,422	2042/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	440	413	66,520	2027/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.7000	390	334	53,853	2032/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9000	90	63	10,153	2052/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	100	91	14,753	2029/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.5500	110	107	17,341	2032/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	270	268	43,086	2043/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.8000	320	320	51,579	2026/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.1500	200	204	32,842	2033/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.9000	560	596	95,824	2039/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.5500	260	273	43,893	2033/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.5000	340	353	56,849	2029/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.5000	520	519	83,443	2027/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.2500	300	307	49,371	2034/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.0000	200	211	33,929	2054/10/31
イタリヤ	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.5000	190	211	34,016	2027/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	200	214	34,435	2028/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.2500	250	277	44,588	2029/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.0000	130	152	24,477	2031/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.7500	240	281	45,226	2033/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	170	191	30,716	2034/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	220	247	39,785	2039/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	180	202	32,511	2040/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	130	133	21,417	2026/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	90	79	12,853	2046/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	20	17	2,878	2032/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	220	217	35,017	2025/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6000	130	127	20,493	2026/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.7000	150	121	19,466	2047/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2500	170	146	23,621	2036/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	90	68	10,933	2067/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	10	9	1,463	2048/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0500	160	156	25,233	2027/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.9500	200	181	29,173	2038/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	190	185	29,781	2028/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	20	19	3,209	2028/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	20	19	3,203	2025/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	10	9	1,546	2049/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.0000	120	120	19,333	2029/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1000	150	148	23,839	2026/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.1000	220	199	32,114	2040/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.3500	170	155	24,971	2030/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.8500	120	114	18,474	2027/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	520	460	73,956	2030/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	20	15	2,558	2036/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	280	208	33,499	2050/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	210	199	32,010	2027/09/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	260	251	40,452	2026/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8000	120	89	14,351	2041/03/01

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	0.9000	260	225	36,217	2031/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.6000	50	42	6,755	2031/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	60	57	9,232	2026/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.2500	180	164	26,466	2028/03/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	130	85	13,699	2045/04/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1500	140	87	14,108	2072/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	100	85	13,731	2031/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	200	189	30,515	2026/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.4500	170	152	24,544	2029/02/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	250	210	33,850	2032/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1500	100	68	10,978	2052/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.1000	130	124	20,051	2027/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	250	248	39,900	2029/06/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	290	272	43,874	2032/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	350	329	52,989	2038/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.6500	270	269	43,265	2027/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	30	31	5,013	2035/04/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	80	80	12,969	2026/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	410	426	68,538	2029/12/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.4000	360	387	62,275	2033/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4000	420	428	68,856	2028/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.4500	430	452	72,744	2043/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	200	210	33,839	2053/10/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8000	510	518	83,290	2026/04/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	120	126	20,280	2031/10/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.7000	200	206	33,153	2030/06/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.6000	220	221	35,598	2025/09/29
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.2000	200	211	33,990	2034/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.1000	100	104	16,852	2029/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.9500	530	532	85,582	2027/02/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	170	173	27,830	2031/02/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.1500	350	359	57,771	2039/10/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.3500	430	436	70,248	2029/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	400	410	65,996	2034/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	370	374	60,284	2031/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0500	350	360	57,976	2037/10/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	400	407	65,485	2027/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.1000	250	251	40,430	2026/08/28
フィンランド	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.6250	10	9	1,532	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	60	53	8,594	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	70	67	10,887	2026/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.3750	10	7	1,190	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.1250	100	86	13,943	2034/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	160	148	23,812	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	50	45	7,281	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	40	29	4,711	2036/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.2500	70	45	7,377	2040/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	50	42	6,908	2030/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	60	28	4,641	2052/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	40	33	5,426	2031/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	120	114	18,335	2026/09/15

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	
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	10	6	1,040	2043/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	210	192	31,006	2032/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.7500	100	97	15,750	2038/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.9500	30	29	4,772	2055/04/15
オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	6.2500	80	88	14,211	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.1500	90	101	16,380	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.8500	150	154	24,904	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.8000	20	23	3,766	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	50	50	8,189	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	60	57	9,302	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	200	190	30,576	2027/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	80	75	12,147	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	110	100	16,236	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	70	61	9,834	2030/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	80	47	7,653	2051/03/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	20	12	2,033	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	260	161	26,033	2040/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	170	144	23,159	2031/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7000	70	33	5,309	2071/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.2500	60	44	7,076	2036/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	190	171	27,637	2028/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.9000	100	88	14,223	2032/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.8500	190	151	24,372	2049/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.9000	180	183	29,421	2033/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	50	50	8,175	2053/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.4500	140	147	23,659	2030/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.9000	150	152	24,469	2034/02/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.2000	80	82	13,217	2039/07/15	
小	計		—	67,950	63,582	10,221,548	—
合	計		—	—	—	33,366,903	—

※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

(2024年8月26日現在)

項 目	期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
公 社 債	33,366,903	95.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,427,902	4.1
投 資 信 託 財 産 総 額	34,794,805	100.0

※期末における外貨建資産(33,707,061千円)の投資信託財産総額(34,794,805千円)に対する比率は96.9%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=143.56円、1カナダ・ドル=106.32円、1オーストラリア・ドル=97.51円、1シンガポール・ドル=110.43円、1ニュージーランド・ドル=89.41円、1イギリス・ポンド=189.77円、1イスラエル・シェケル=38.942円、1デンマーク・クローネ=21.55円、1ノルウェー・クローネ=13.74円、1スウェーデン・クローナ=14.08円、1メキシコ・ペソ=7.473円、1オフショア・人民元=20.184円、1ポーランド・ズロチ=37.684円、1ユーロ=160.76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

(2024年8月26日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	68,537,776,251円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	269,567,880
公 社 債 (評 価 額)	33,366,903,244
未 収 入 金	34,636,726,768
未 収 利 息	178,653,774
前 払 費 用	85,924,585
(B) 負 債	33,763,496,327
未 払 金	33,760,496,327
未 払 解 約 金	3,000,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	34,774,279,924
元 本	28,197,908,308
次 期 繰 越 損 益 金	6,576,371,616
(D) 受 益 権 総 口 数	28,197,908,308口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	12,332円

※当期における期首元本額15,557,816,902円、期中追加設定元本額18,932,216,845円、期中一部解約元本額6,292,125,439円です。
 ※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。
 アセットアロケーション・ファンド(安定型) 2,028,592,924円
 アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) 2,208,049,207円
 アセットアロケーション・ファンド(成長型) 848,422,165円
 イオン・バランス戦略ファンド 1,252,449,911円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) 3,389,550,780円
 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) 1,579,670,649円
 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) 2,635,209,960円
 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) 718,581,155円
 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) 97,175,055円
 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド 127,986,090円
 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり) 333,949,579円
 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型) 11,708,796円
 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型) 135,633,796円
 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型) 343,640,785円
 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型) 175,338,470円
 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型) 15,592,614円

SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> 975,928,543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> 8,508,858,332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> 915,871,890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> 474,785,315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> 756,792,191円
 三井住友・ニュー・アジア・ファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定> 664,120,101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2023年8月26日 至2024年8月26日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	583,955,500円
受 取 利 息	583,983,890
そ の 他 収 益 金	648
支 払 利 息	△ 29,038
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 112,206,093
売 買 損 益	5,443,195,085
売 買 損 益	△ 5,555,401,178
(C) そ の 他 費 用 等	△ 17,026,744
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	454,722,663
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,417,712,385
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 1,396,920,577
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,100,857,145
(H) 合 計 (D + E + F + G)	6,576,371,616
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	6,576,371,616

※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20期（2022年12月20日から2023年12月18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。 ・ 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、 円換算ベース)		公 社 債 率 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
16期（2019年12月17日）	円	%		%	%	百万円
17期（2020年12月17日）	18,248	4.0	184.64	4.1	98.6	171,892
18期（2021年12月17日）	19,109	4.7	193.48	4.8	99.0	161,689
19期（2022年12月19日）	19,947	4.4	201.87	4.3	99.1	162,393
20期（2023年12月18日）	19,845	△0.5	200.98	△0.4	98.9	154,701
	21,452	8.1	217.73	8.3	99.1	169,321

※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、 円換算ベース)		公 社 債 組 入 比 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	%	
(期 首) 2022年12月19日	19,845	—	200.98	—	98.9
12月末	19,003	△4.2	192.47	△4.2	99.7
2023年 1 月末	19,227	△3.1	194.97	△3.0	97.9
2 月末	19,458	△2.0	197.06	△2.0	99.0
3 月末	19,703	△0.7	199.59	△0.7	98.6
4 月末	19,845	0.0	200.89	△0.0	98.7
5 月末	20,355	2.6	206.26	2.6	98.6
6 月末	21,163	6.6	214.73	6.8	98.7
7 月末	20,708	4.3	209.99	4.5	98.4
8 月末	21,270	7.2	215.66	7.3	98.8
9 月末	20,957	5.6	212.44	5.7	98.6
10月末	20,931	5.5	212.31	5.6	98.6
11月末	21,659	9.1	219.71	9.3	98.4
(期 末) 2023年12月18日	21,452	8.1	217.73	8.3	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（2022年12月20日から2023年12月18日まで）

基準価額等の推移



期首	19,845円
期末	21,452円
騰落率	+8.1%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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（2022年12月20日から2023年12月18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、円換算ベース）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：金利の変動による債券価格の感応度）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

- ・ 対円で投資通貨が上昇したこと
- ・ 保有する債券から得られるインカム収益

▶ **投資環境について（2022年12月20日から2023年12月18日まで）**

債券市場は、米欧の長期金利はまちまちな動きとなりましたが、債券の利息収益などにより、トータルリターンはプラスとなりました。為替市場は投資通貨が対円で総じて上昇しました。

債券市場

シリコンバレー銀行の破綻を受けて、米欧金利の急低下が見られた場面はありましたが、その後の底堅い経済指標などを背景に、先進国中銀の金融引き締め長期化などが警戒され、米欧金利は大きく上昇しました。

期末にかけては、米国などで景気減速の兆候が確認され、米欧金利は期中の上昇幅を縮小しました。

為替市場

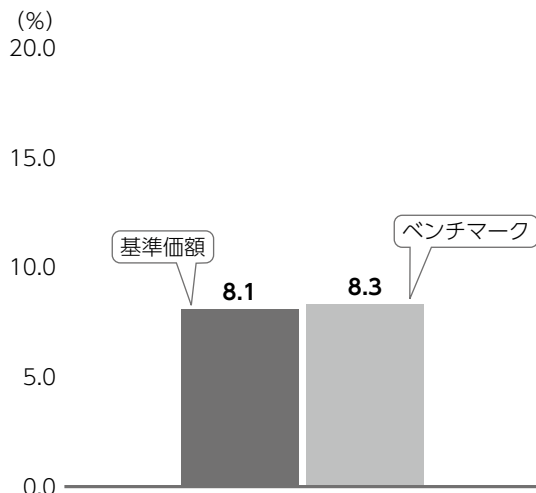
グローバルに長期金利が上昇するなか、対円で投資通貨は総じて上昇しました。日本銀行は段階的に金融政策の正常化を進めたものの、金融緩和的な姿勢を維持したことも円売り圧力となり、投資通貨の対円での上昇要因となりました。

▶ **ポートフォリオについて（2022年12月20日から2023年12月18日まで）**

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、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。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 (2022年12月20日から2023年12月18日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

記載のグラフは、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+8.1%となり、ベンチマークの騰落率+8.3%を0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因 ・ 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

債券市場は、これまでの利上げに伴う景気減速が見込まれる中、F R B（米連邦準備制度理事会）など、グローバルに中銀のタカ派（インフレ抑制を重視する立場）姿勢が緩むことで、金利の緩やかな低下を予想します。為替市場は、日本の貿易赤字拡大などの構造的な円安圧力が残るとみられるものの、グローバルに中銀のタカ派姿勢が緩むことも見込まれるなか、来年にかけては、海外通貨高・円安圧力が後退に向かう展開を予想します。

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（2022年12月20日から2023年12月18日まで）

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) そ の 他 費 用	8円	0.037%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送回国・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
（保 管 費 用）	(7)	(0.037)	
（そ の 他）	(0)	(0.000)	
合 計	8	0.037	

期中の平均基準価額は20,380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 (2022年12月20日から2023年12月18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 166,414	千アメリカ・ドル 175,494
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 13,968	千カナダ・ドル 13,496
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 4,961	千オーストラリア・ドル 6,172
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 652	千シンガポール・ドル 1,091
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 1,220	千ニュージーランド・ドル 614
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 13,030	千イギリス・ポンド 6,630
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シェケル 5,031	千イスラエル・シェケル 5,601
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 2,265	千デンマーク・クローネ 6,692
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 3,842	千ノルウェー・クローネ 5,381
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 1,648	千スウェーデン・クローナ -
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 46,326	千メキシコ・ペソ 45,107
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 390,413	千オフショア・人民元 42,117
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 4,963	千マレーシア・リンギット 4,212
	国	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 7,738
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ
アイルランド		国債証券	165	753
	オランダ	国債証券	4,106	4,795

外国債券パッシブ・マザーファンド

			買 付 額	売 付 額
外	ベルギー	国債証券	3,419	4,448
	フランス	国債証券	17,460	18,347
	ドイツ	国債証券	19,721	20,478
	スペイン	国債証券	14,572	15,450
	イタリア	国債証券	16,695	17,408
国	フィンランド	国債証券	2,004	1,815
	オーストリア	国債証券	2,481	2,030

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年12月20日から2023年12月18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12月20日から2023年12月18日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2023年12月18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 618,370	千アメリカ・ドル 557,146	千円 79,226,218	% 46.8	% -	% 20.3	% 18.1	% 8.4
カナダ	千カナダ・ドル 32,880	千カナダ・ドル 31,746	3,374,302	2.0	-	1.1	0.4	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 27,550	千オーストラリア・ドル 24,820	2,367,160	1.4	-	1.0	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 6,900	千シンガポール・ドル 6,731	718,689	0.4	-	0.3	0.2	0.0

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
ニュージーランド	千ニュージーランド・ ドル 5,090	千ニュージーランド・ ドル 4,419	391,136	0.2	—	0.1	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 56,700	千イギリス・ポンド 48,955	8,829,074	5.2	—	3.7	1.1	0.5
イスラエル	千イスラエル・シケル 13,700	千イスラエル・シケル 13,001	502,544	0.3	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 22,100	千デンマーク・クローネ 22,378	465,241	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 22,900	千ノルウェー・クローネ 21,430	290,591	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 24,900	千スウェーデン・クローナ 24,916	344,849	0.2	—	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 194,000	千メキシコ・ペソ 182,768	1,508,916	0.9	—	0.6	0.2	0.1
中 国	千オフショア・人民元 625,900	千オフショア・人民元 635,185	12,668,272	7.5	—	3.2	3.2	1.0
マレーシア	千マレーシア・リンギット 27,100	千マレーシア・リンギット 27,761	845,469	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 27,200	千ポーランド・ズロチ 24,162	863,842	0.5	—	0.2	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
アイルランド	6,600	6,095	944,746	0.6	—	0.4	0.1	0.1
オランダ	17,300	16,539	2,563,695	1.5	—	0.9	0.5	0.1
ベルギー	21,050	19,378	3,003,708	1.8	—	1.2	0.5	0.1
フランス	97,470	91,058	14,114,093	8.3	—	4.9	2.5	0.9
ドイツ	74,750	71,256	11,044,707	6.5	—	3.6	2.1	0.9
スペイン	54,700	53,007	8,216,216	4.9	—	2.9	1.4	0.6
イタリア	84,520	81,451	12,624,939	7.5	—	4.2	2.2	1.1
フィンランド	6,100	5,467	847,436	0.5	—	0.3	0.2	0.0
オーストリア	14,000	12,872	1,995,293	1.2	—	0.7	0.3	0.1
合 計	—	—	167,751,148	99.1	—	50.4	33.9	14.8

※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。
 ※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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	3.1250	2,300	1,967	279,793	2043/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,200	985	140,134	2043/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	500	459	65,370	2043/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	700	654	93,119	2043/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	500	441	62,741	2044/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	300	275	39,135	2044/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,300	1,101	156,685	2044/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,500	2,419	344,095	2025/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,000	828	117,842	2044/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,400	1,061	151,004	2045/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	600	579	82,344	2025/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	900	743	105,775	2045/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,300	3,166	450,231	2025/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	800	646	91,875	2045/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,000	3,839	545,991	2025/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	800	659	93,740	2045/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	2,900	2,737	389,311	2026/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,000	751	106,863	2046/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	11,450	10,764	1,530,742	2026/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	1,000	750	106,650	2046/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,950	1,389	197,594	2046/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	1,000	941	133,904	2026/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,000	2,407	342,312	2046/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,162	591,887	2027/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,500	2,049	291,374	2047/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	3,000	2,839	403,828	2027/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,800	1,474	209,636	2047/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,200	3,947	561,345	2027/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,800	1,406	199,981	2047/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,500	1,171	166,619	2047/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,121	586,118	2027/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,600	2,531	359,970	2024/11/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,900	3,797	540,005	2024/12/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,400	3,314	471,325	2025/01/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	5,300	5,047	717,785	2028/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,400	1,962	279,088	2048/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	1,952	277,688	2025/02/28	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,000	973	138,433	2025/03/31	

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	2.8750	400	390	55,493	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,500	3,342	475,358	2028/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,400	2,007	285,398	2048/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,100	3,022	429,821	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	900	875	124,492	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	4,500	4,291	610,202	2028/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,000	1,634	232,394	2048/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,400	3,300	469,352	2025/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,000	974	138,561	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,600	2,532	360,085	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,900	2,792	397,076	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	3,100	2,712	385,655	2048/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,500	2,428	345,265	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,400	1,352	192,281	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,200	2,123	301,899	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,800	1,688	240,046	2029/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,300	2,696	383,422	2049/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	2,100	2,019	287,185	2026/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	8,200	7,838	1,114,605	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,400	2,216	315,250	2029/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,400	1,117	158,925	2049/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	2,500	2,356	335,062	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,750	3,322	472,464	2029/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,500	2,455	349,216	2049/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	600	557	79,246	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	900	840	119,546	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,300	1,155	164,347	2029/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,900	1,369	194,764	2049/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	200	186	26,470	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	800	774	110,120	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	2,100	1,822	259,169	2030/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,800	1,853	263,530	2050/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,000	1,824	259,475	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,600	1,515	215,472	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	2,400	2,147	305,363	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	2,500	2,333	331,805	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	4,400	4,068	578,484	2027/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,500	1,436	204,296	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,900	1,829	260,104	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	4,000	3,874	550,894	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	5,000	4,068	578,547	2030/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	5,100	2,765	393,301	2050/05/15

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	0.2500	4,400	4,128	587,106	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,800	2,436	346,441	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	2,500	2,216	315,211	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,829	402,300	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,200	1,066	151,681	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,900	2,713	385,880	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	4,000	3,536	502,830	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	300	279	39,797	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,500	2,194	311,997	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	4,800	3,876	551,296	2030/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	4,500	2,523	358,779	2050/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,100	1,969	280,123	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,000	1,855	263,817	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	4,800	4,191	596,100	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	4,900	4,009	570,209	2030/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,200	1,918	272,773	2050/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	5,700	4,737	673,680	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	5,800	3,703	526,568	2051/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	5,900	5,179	736,515	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,000	1,849	262,996	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,768	393,645	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	3,400	2,984	424,374	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,200	6,304	896,494	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,500	2,311	328,750	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	3,300	2,365	336,323	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,000	875	124,460	2027/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,000	925	131,539	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	5,500	4,700	668,476	2031/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	1,500	1,381	196,517	2026/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	3,900	2,801	398,354	2051/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	5,000	3,800	540,438	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	2,000	1,838	261,429	2026/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	2,000	1,841	261,923	2026/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	3,000	2,663	378,773	2028/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	3,000	2,668	379,473	2028/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	5,200	4,288	609,890	2031/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,500	3,077	437,582	2028/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,900	1,907	271,185	2051/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	4,400	3,054	434,328	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	800	729	103,765	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	2,900	2,539	361,170	2028/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	1,500	1,369	194,742	2026/08/31

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	1.2500	3,000	2,648	376,589	2028/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	2,500	2,286	325,190	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	3,300	2,102	298,956	2051/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	4,900	4,056	576,787	2031/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,700	3,400	483,522	2026/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,200	3,866	549,759	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	3,000	2,659	378,189	2028/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,800	2,744	390,215	2041/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	4,500	4,331	615,878	2024/12/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	4,500	4,006	569,792	2028/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,000	1,922	273,439	2025/01/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,300	2,115	300,757	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,500	2,208	313,984	2028/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	5,300	4,544	646,203	2032/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	3,000	2,888	410,683	2025/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	4,300	3,864	549,592	2029/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,800	2,145	305,074	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,700	1,187	168,862	2052/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	2,800	2,528	359,538	2029/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	3,400	3,175	451,521	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,500	1,445	205,574	2025/03/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	5,000	4,625	657,738	2029/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	4,500	4,378	622,648	2025/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,000	2,857	406,285	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,500	3,317	471,799	2029/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	5,700	5,269	749,303	2032/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,000	2,920	415,333	2025/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,600	1,534	218,150	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	2,200	1,928	274,198	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,200	2,565	364,837	2052/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,000	1,948	277,133	2025/06/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	4,800	4,579	651,148	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,400	1,317	187,352	2029/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,000	1,951	277,483	2025/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	3,000	2,895	411,681	2029/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,200	3,836	545,501	2032/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	3,000	2,931	416,882	2025/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,100	1,026	145,994	2029/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	3,000	2,672	380,045	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,000	2,468	351,066	2052/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,700	2,585	367,664	2029/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	2,000	1,991	283,171	2025/10/15

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	3.8750	2,300	2,289	325,539	2029/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	5,600	5,679	807,603	2032/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	3,800	3,803	540,808	2025/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	3,500	3,512	499,456	2027/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	1,600	1,602	227,936	2029/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	2,000	1,944	276,487	2042/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	2,600	2,580	366,972	2052/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	1,500	1,490	211,960	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	3,500	3,474	494,051	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	5,300	5,246	746,002	2026/01/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	4,400	4,379	622,826	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	1,500	1,493	212,316	2029/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	6,100	5,900	839,020	2033/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	1,000	981	139,508	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	3,800	3,792	539,257	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	2,000	1,985	282,309	2026/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	2,500	2,437	346,665	2030/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	2,600	2,480	352,668	2043/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	1,700	1,579	224,561	2053/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	1,500	1,503	213,790	2030/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	5,000	5,001	711,191	2028/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	2,500	2,515	357,693	2026/03/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	3,300	3,260	463,657	2026/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	3,000	2,957	420,572	2028/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	1,200	1,177	167,500	2030/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	5,500	5,265	748,735	2033/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	1,000	988	140,583	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	2,500	2,463	350,373	2026/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	2,000	1,972	280,549	2028/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	2,500	2,436	346,452	2030/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	1,500	1,430	203,417	2043/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	2,100	1,953	277,809	2053/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	2,000	1,994	283,603	2026/06/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	3,000	2,965	421,664	2030/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	3,000	3,005	427,346	2028/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	3,900	3,926	558,345	2026/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	1,000	1,007	143,232	2028/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	4,400	4,348	618,378	2030/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	5,000	4,981	708,333	2033/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	4,000	4,016	571,120	2026/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	2,200	2,206	313,712	2030/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	500	510	72,582	2043/08/15

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	4.1250	1,000	1,016	144,587	2053/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	500	505	71,813	2030/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	4,000	4,045	575,216	2026/09/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	1,000	1,018	144,815	2028/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	1,000	1,012	143,910	2026/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	1,500	1,560	221,863	2030/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	2,400	2,514	357,569	2033/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	2,800	2,835	403,228	2026/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.0000	1,000	1,033	146,987	2026/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.1250	1,000	1,075	152,924	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	5.2500	500	528	75,185	2028/11/15
	US TREASURY BOND	国債証券	5.3750	320	350	49,782	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	2,000	2,118	301,190	2038/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	200	188	26,811	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	100	102	14,585	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	300	316	44,950	2039/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	300	311	44,250	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	1,000	1,066	151,697	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	900	930	132,328	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	500	485	69,056	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	600	609	86,633	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.7500	900	969	137,857	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	300	308	43,901	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	1,100	1,044	148,552	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,000	867	123,416	2041/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,000	865	123,062	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	800	676	96,223	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	1,621	230,634	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	300	242	34,481	2042/11/15
	小 計		—	618,370	557,146	79,226,218	—
カ ナ ダ	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	千カナダ・ドル 250	千カナダ・ドル 282	29,994	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	300	363	38,671	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.0000	400	481	51,212	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0000	1,300	1,474	156,681	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	1,200	1,301	138,356	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	500	487	51,768	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,300	1,257	133,635	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,600	2,470	262,602	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	800	740	78,654	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	700	665	70,737	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,100	1,051	111,786	2029/06/01

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	
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	500	444	47,262	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	2,700	2,547	270,742	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,100	845	89,858	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	400	373	39,718	2027/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,300	2,036	216,490	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	300	289	30,781	2025/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,000	953	101,320	2029/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	2,000	1,832	194,787	2032/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	2,300	2,250	239,171	2027/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	900	884	94,048	2025/10/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	2,930	2,786	296,194	2032/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	200	196	20,907	2026/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,800	1,746	185,614	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	192	20,479	2055/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	1,000	990	105,288	2025/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	300	303	32,256	2033/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5000	1,800	1,817	193,216	2025/11/01
	CANADA GOVERNMENT	国債証券	2.7500	700	677	72,063	2064/12/01
	小 計		—	32,880	31,746	3,374,302	—
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	千オーストラリア・ドル 800	千オーストラリア・ドル 776	74,090	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5000	1,500	1,543	147,217	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2500	2,150	2,170	207,030	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	900	853	81,407	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	800	695	66,332	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	2,600	2,502	238,683	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	2,000	1,752	167,170	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,300	1,218	116,222	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	1,200	941	89,766	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	190	18,165	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,800	1,691	161,360	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	2,200	2,022	192,928	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	600	478	45,669	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	4,400	3,688	351,727	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	800	639	61,016	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	284	27,151	2051/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	1,300	1,213	115,727	2025/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	100	91	8,724	2026/09/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,400	1,155	110,160	2032/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	1,000	908	86,606	2033/11/21
	小 計		—	27,550	24,820	2,367,160	—

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	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 1,000	千シンガポール・ドル 1,017	108,660	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	200	201	21,501	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	700	690	73,696	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	400	421	44,962	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,000	974	103,984	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,000	946	100,994	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	796	85,040	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	200	189	20,283	2025/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	1,000	923	98,539	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	600	571	61,026	2026/11/01
小 計			-	6,900	6,731	718,689	-
ニュージーランド	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	4.5000	千ニュージーランド・ドル 1,100	千ニュージーランド・ドル 1,100	97,423	2027/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	550	534	47,288	2025/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	3.0000	1,000	933	82,593	2029/04/20
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	1.7500	700	446	39,540	2041/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	500	343	30,431	2051/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	0.5000	100	90	8,034	2026/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.0000	970	799	70,749	2032/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	4.5000	170	170	15,075	2030/05/15
小 計			-	5,090	4,419	391,136	-
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 718	129,631	2028/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	500	522	94,260	2032/06/07
	UK GILT	国債証券	5.0000	1,300	1,307	235,744	2025/03/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	700	725	130,780	2036/03/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	1,000	1,080	194,888	2038/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,700	1,726	311,433	2055/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,500	1,513	272,932	2046/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	917	165,504	2027/12/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	1,050	1,098	198,135	2042/12/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	1,150	1,231	222,078	2030/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	908	163,897	2049/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	600	612	110,508	2039/09/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	400	424	76,556	2034/09/07
	UK GILT	国債証券	4.0000	1,300	1,275	230,082	2060/01/22
	UK GILT	国債証券	4.2500	600	611	110,201	2040/12/07
	UK GILT	国債証券	3.7500	1,200	1,116	201,342	2052/07/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	1,600	1,399	252,400	2044/01/22
	UK GILT	国債証券	3.5000	1,300	1,158	208,875	2068/07/22
	UK GILT	国債証券	3.5000	1,250	1,130	203,876	2045/01/22

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	2.0000	1,100	1,059	191,139	2025/09/07
	UK GILT	国債証券	2.5000	1,600	1,107	199,816	2065/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	1,100	1,036	186,882	2026/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	2,000	1,202	216,896	2047/07/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	100	76	13,815	2037/09/07
	UK GILT	国債証券	1.2500	900	826	148,997	2027/07/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	900	821	148,247	2028/10/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	1,950	1,222	220,469	2049/01/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	500	282	50,975	2054/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	500	429	77,496	2029/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	900	853	153,882	2025/06/07
	UK GILT	国債証券	0.3750	600	484	87,379	2030/10/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	2,700	1,732	312,472	2041/10/22
	UK GILT	国債証券	0.5000	900	300	54,115	2061/10/22
	UK GILT	国債証券	0.1250	1,300	1,199	216,345	2026/01/30
	UK GILT	国債証券	0.1250	1,400	1,213	218,800	2028/01/31
	UK GILT	国債証券	0.6250	1,900	1,328	239,625	2035/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	1,300	1,010	182,314	2031/07/31
	UK GILT	国債証券	0.3750	1,800	1,632	294,429	2026/10/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	1,200	632	114,053	2051/07/31
	UK GILT	国債証券	0.8750	1,300	1,002	180,790	2033/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	700	667	120,331	2025/01/31
	UK GILT	国債証券	0.5000	2,050	1,752	316,071	2029/01/31
	UK GILT	国債証券	1.0000	2,100	1,711	308,669	2032/01/31
	UK GILT	国債証券	1.1250	300	122	22,165	2073/10/22
	UK GILT	国債証券	4.1250	1,700	1,710	308,572	2027/01/29
	UK GILT	国債証券	3.7500	1,100	1,067	192,611	2038/01/29
	UK GILT	国債証券	3.5000	700	690	124,509	2025/10/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	2,100	2,027	365,645	2033/01/31
	UK TSY GILT	国債証券	1.1250	400	268	48,420	2039/01/31
	小 計		—	56,700	48,955	8,829,074	—
イスラエル	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	千イスラエル・シケル 3,600	千イスラエル・シケル 3,250	125,653	2047/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.2500	3,200	3,430	132,604	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.2500	1,700	1,599	61,807	2028/09/28
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.0000	700	594	22,985	2030/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	900	656	25,378	2037/05/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.5000	3,100	2,966	114,658	2025/04/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	500	503	19,456	2029/02/28
	小 計		—	13,700	13,001	502,544	—
デンマーク	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 7,000	千デンマーク・クローネ 8,972	186,533	2039/11/15

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	
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.7500	100	98	2,047	2025/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	6,100	5,725	119,038	2027/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	5,400	4,925	102,395	2029/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.2500	1,800	1,033	21,492	2052/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.0000	500	422	8,790	2031/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	2.2500	1,200	1,199	24,943	2033/11/15
	小 計		-	22,100	22,378	465,241	-
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	千ノルウェー・クローネ 1,200	千ノルウェー・クローネ 1,170	15,866	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,300	2,204	29,890	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	190	2,586	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	5,900	5,624	76,265	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	5,000	4,633	62,823	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.3750	6,800	6,077	82,409	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	800	785	10,653	2033/08/15
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	700	744	10,095	2042/10/06
	小 計		-	22,900	21,430	290,591	-
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 5,300	千スウェーデン・クローナ 6,155	85,191	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.5000	5,000	4,968	68,761	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.0000	6,200	5,965	82,562	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	3,700	3,490	48,313	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	4,200	3,901	53,998	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	500	435	6,022	2031/05/12
	小 計		-	24,900	24,916	344,849	-
メキシコ	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	10.0000	千メキシコ・ペソ 11,000	千メキシコ・ペソ 10,931	90,251	2024/12/05
	MEX BONOS DE DESARROLLO	国債証券	7.5000	22,000	20,859	172,212	2027/06/03
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	25,000	24,475	202,065	2029/05/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	40,000	38,078	314,374	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	29,000	26,982	222,762	2031/05/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	18,000	16,406	135,451	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.7500	19,000	17,561	144,987	2026/03/05
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	9,000	8,019	66,210	2047/11/07
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.5000	3,000	2,691	22,220	2027/03/04
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.0000	12,000	11,349	93,696	2025/03/06
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.5000	6,000	5,412	44,682	2033/05/26
	小 計		-	194,000	182,768	1,508,916	-
中 国	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	千オフショア・人民元 50,000	千オフショア・人民元 50,359	1,004,379	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	21,000	21,405	426,919	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7200	38,700	44,171	880,955	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	43,000	44,242	882,376	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2600	18,000	17,972	358,439	2025/02/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	26,000	26,341	525,362	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	9,000	9,004	179,585	2027/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2400	31,000	30,923	616,743	2025/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	16,000	16,025	319,617	2027/07/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	39,000	38,851	774,860	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	19,000	19,051	379,966	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	21,000	21,268	424,185	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	12,000	12,348	246,282	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	31,500	31,699	632,219	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	29,000	29,027	578,931	2026/02/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	15,163	302,426	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	10,900	11,120	221,796	2033/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	27,000	27,189	542,273	2028/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	17,000	16,971	338,478	2026/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	5,000	5,007	99,877	2033/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	8,000	8,412	167,770	2053/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	17,000	17,019	339,434	2030/06/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	41,000	40,861	814,940	2028/07/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	9,800	9,746	194,391	2026/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5200	13,000	12,887	257,029	2033/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	32,000	32,012	638,463	2030/09/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	9,000	9,032	180,154	2028/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3900	14,000	14,002	279,269	2026/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,000	3,065	61,140	2053/10/15
	小 計		-	625,900	635,185	12,668,272	-
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	千マレーシア・リンギット 5,100	千マレーシア・リンギット 5,077	154,623	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	4,000	4,170	127,005	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	3,200	3,223	98,161	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	6,700	7,146	217,629	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	2,500	2,436	74,192	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	1,700	1,834	55,860	2042/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	700	724	22,060	2029/04/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	500	503	15,319	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,300	1,311	39,939	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,335	40,676	2040/05/22
	小 計		-	27,100	27,761	845,469	-
ポーランド	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	千ポーランド・ズロチ 2,500	千ポーランド・ズロチ 2,309	82,559	2028/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	700	633	22,647	2029/10/25

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	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,800	1,702	60,854	2025/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	7,800	6,241	223,146	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	7,400	6,532	233,555	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,000	4,593	164,223	2025/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,000	2,149	76,856	2033/10/25
	小 計		—	27,200	24,162	863,842	—
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	824	127,726	2025/03/13
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.4000	600	605	93,818	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.0000	1,100	955	148,159	2045/02/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.0000	800	773	119,916	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.7000	300	268	41,637	2037/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.9000	500	472	73,242	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3000	500	455	70,535	2033/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3500	500	469	72,761	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.1000	500	471	73,014	2029/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.5000	500	380	59,017	2050/05/15
オランダ	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.0000	500	418	64,917	2031/10/18
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	5.5000	700	787	122,108	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	4.0000	300	350	54,383	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	1,300	1,537	238,285	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	600	610	94,558	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.7500	2,200	2,316	359,130	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	1,300	1,252	194,072	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,300	1,240	192,293	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	400	379	58,883	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	1,500	1,405	217,926	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	500	449	69,696	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,500	1,113	172,542	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	2,200	1,907	295,589	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	1,300	1,213	188,033	2027/01/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,700	1,468	227,548	2032/07/15	
NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	500	507	78,640	2033/07/15	
ベルギー	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	1,000	1,129	175,035	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0000	1,000	1,219	188,974	2035/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.2500	900	1,056	163,773	2041/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5000	1,100	1,147	177,925	2026/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	300	333	51,699	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	600	667	103,406	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	200	206	31,933	2034/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	700	679	105,345	2025/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	1,300	1,171	181,634	2031/06/22

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	
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9000	1,000	885	137,232	2038/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	700	675	104,740	2026/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6000	650	492	76,390	2047/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.1500	500	403	62,475	2066/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	800	759	117,653	2027/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	500	416	64,514	2057/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4500	1,200	1,015	157,476	2037/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	1,000	937	145,258	2028/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.2500	900	804	124,767	2033/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9000	900	835	129,444	2029/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.7000	1,100	827	128,337	2050/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.1000	700	605	93,790	2030/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.4000	800	535	82,990	2040/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	800	732	113,582	2027/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.6500	400	185	28,680	2071/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	1,500	1,238	191,952	2031/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.3500	500	417	64,692	2032/06/22
フランス	FRANCE O. A. T.	国債証券	6.0000	2,100	2,226	345,062	2025/10/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.5000	1,650	1,909	295,928	2029/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.7500	400	503	77,986	2032/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.7500	800	964	149,503	2035/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	1,370	1,634	253,314	2055/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	2,000	2,292	355,297	2038/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.5000	1,900	2,322	360,043	2041/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	1,400	1,693	262,526	2060/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.5000	1,800	1,840	285,330	2026/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	2,650	2,690	416,989	2027/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.2500	900	944	146,335	2045/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	2,600	2,627	407,203	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,300	1,257	194,969	2025/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	1,500	1,455	225,548	2025/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	3,050	2,872	445,235	2031/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	3,300	3,148	488,063	2026/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	2,750	2,328	360,991	2036/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	800	580	90,041	2066/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.2500	2,900	2,725	422,489	2026/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	2,700	2,352	364,659	2039/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	2,200	2,103	326,019	2027/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	2,000	1,666	258,347	2048/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,100	2,898	449,344	2028/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	1,200	1,054	163,499	2034/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,100	2,878	446,230	2028/11/25

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	1.5000	2,400	1,758	272,490	2050/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	3,000	2,726	422,601	2029/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,900	1,830	283,730	2025/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,500	3,056	473,765	2029/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,000	1,737	269,318	2052/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	2,000	1,894	293,669	2026/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,900	3,319	514,568	2030/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,300	901	139,770	2040/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	100	42	6,647	2072/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,200	755	117,081	2044/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,000	2,485	385,224	2031/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,100	1,021	158,292	2027/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,000	2,896	448,934	2025/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	2,900	2,368	367,165	2032/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	900	734	113,815	2038/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	4,200	3,941	610,859	2028/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	3,000	2,888	447,790	2032/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	1,300	1,214	188,263	2043/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	2,200	2,203	341,501	2026/09/24
	FRANCE OAT.	国債証券	3.0000	1,500	1,561	242,006	2033/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	1,100	1,122	173,959	2029/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.5000	1,500	1,623	251,676	2033/11/25
ド イ ツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.5000	1,000	1,148	177,969	2027/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.6250	1,000	1,138	176,399	2028/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	1,600	1,790	277,519	2028/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	800	994	154,191	2030/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.5000	900	1,108	171,762	2031/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	600	751	116,500	2034/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.0000	1,300	1,568	243,051	2037/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.2500	700	883	136,966	2039/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	1,450	1,947	301,884	2040/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	3.2500	1,000	1,147	177,924	2042/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	1,600	1,662	257,627	2044/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	2,700	2,820	437,219	2046/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,350	2,284	354,163	2025/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,900	1,850	286,789	2025/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	3,200	3,074	476,551	2026/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	500	471	73,131	2027/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,100	1,986	307,958	2027/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.2500	1,650	1,351	209,510	2048/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	1,600	1,505	233,390	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	1,500	1,387	215,043	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	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	1,400	1,285	199,197	2029/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	2,500	2,243	347,808	2029/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,000	1,689	261,795	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,500	1,334	206,838	2030/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	2,000	1,575	244,214	2035/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,800	1,586	245,849	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,300	1,201	186,258	2027/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	800	614	95,174	2036/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	900	509	78,959	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	400	363	56,379	2028/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	600	518	80,334	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	2,300	1,987	308,058	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,200	2,733	423,643	2032/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,400	1,193	184,925	2038/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7000	2,800	2,740	424,725	2032/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.1000	1,400	1,410	218,644	2029/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.8000	200	182	28,210	2053/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.3000	1,600	1,640	254,321	2033/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.3000	800	820	127,238	2033/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.8000	900	820	127,224	2053/08/15
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	3.1000	300	302	46,872	2025/09/18
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	2,800	2,699	418,362	2025/04/11
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	2,600	2,485	385,235	2025/10/10
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	2,100	1,991	308,759	2026/04/10
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	1,000	940	145,779	2026/10/09
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	0.0000	3,200	2,986	462,961	2027/04/16
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	1.3000	300	291	45,258	2027/10/15
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	2.2000	600	604	93,646	2028/04/13
	BUNDESOBLIGATION	国債証券	2.4000	1,600	1,628	252,471	2028/10/19
スペイン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	6.0000	1,900	2,205	341,802	2029/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2000	1,400	1,004	155,717	2040/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.7500	1,000	1,220	189,126	2032/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.2000	1,050	1,160	179,933	2037/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.9000	1,400	1,660	257,444	2040/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.7000	1,500	1,755	272,101	2041/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.6500	800	821	127,396	2025/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.9000	500	539	83,656	2026/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	1,500	1,672	259,290	2028/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	1,400	1,745	270,536	2044/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.6000	1,400	1,373	212,957	2025/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.1500	1,600	1,582	245,356	2025/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	700	667	103,538	2030/07/30

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	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	2,400	2,358	365,594	2026/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.9000	1,700	1,539	238,683	2046/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	1,300	1,225	189,903	2066/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.3000	1,400	1,348	209,088	2026/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.5000	1,500	1,446	224,211	2027/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.3500	700	664	103,059	2033/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	1,800	1,724	267,335	2027/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	2,000	1,902	294,834	2028/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7000	750	647	100,352	2048/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	1,200	1,138	176,434	2028/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	2,100	1,977	306,542	2029/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.8500	1,000	877	136,001	2035/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	1,600	1,397	216,551	2030/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	1,700	1,594	247,205	2027/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	800	454	70,377	2050/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	500	483	74,870	2025/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2500	2,100	1,906	295,449	2030/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	400	203	31,520	2071/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8500	800	588	91,242	2037/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	1,400	1,174	182,030	2031/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.7000	2,200	1,852	287,125	2032/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	2,600	2,491	386,206	2025/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	700	632	98,060	2029/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.5500	1,600	1,557	241,425	2032/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.8000	1,100	1,102	170,825	2026/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.1500	1,500	1,524	236,243	2033/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.9000	200	212	32,868	2039/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.5500	1,500	1,569	243,313	2033/10/31
イタリア	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	7.2500	400	447	69,316	2026/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.5000	1,700	1,917	297,206	2027/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	1,800	1,930	299,297	2028/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	1,100	984	152,650	2030/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	700	489	75,932	2037/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.0000	2,200	2,582	400,258	2031/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.7500	1,700	1,983	307,517	2033/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,570	1,743	270,247	2034/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	2,000	2,025	313,992	2037/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,800	1,991	308,682	2039/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,000	1,020	158,115	2025/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,700	1,885	292,266	2040/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,300	1,341	207,986	2026/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	1,200	1,297	201,183	2044/09/01

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	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	1,000	1,014	157,304	2030/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	1,300	1,289	199,908	2024/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	1,600	1,395	216,228	2046/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	1,900	1,856	287,729	2025/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	1,300	1,276	197,782	2025/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6000	1,200	1,162	180,230	2026/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.7000	1,250	991	153,653	2047/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2500	500	419	64,962	2036/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.2500	800	762	118,242	2026/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	700	517	80,210	2067/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	600	543	84,295	2033/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2000	900	878	136,211	2027/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	1,000	899	139,377	2048/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0500	1,500	1,454	225,452	2027/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.9500	1,000	886	137,410	2038/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	2,500	2,405	372,809	2028/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	700	684	106,042	2025/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	1,300	1,284	199,077	2028/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	1,200	1,189	184,383	2025/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.3500	700	671	104,105	2035/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	1,500	1,427	221,316	2049/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.0000	2,600	2,578	399,643	2029/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1000	1,000	979	151,881	2026/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.1000	700	621	96,276	2040/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.3500	2,400	2,323	360,203	2025/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.8500	1,500	1,409	218,457	2027/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	700	602	93,375	2030/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	400	307	47,591	2036/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	900	662	102,685	2050/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	1,000	981	152,075	2025/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	800	743	115,289	2027/09/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	1,000	949	147,160	2026/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.7000	1,500	929	144,073	2051/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9000	2,000	1,684	261,063	2031/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	2,600	2,154	333,958	2031/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	1,000	926	143,677	2026/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.4500	2,400	2,096	324,919	2029/02/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	3,500	2,857	442,972	2032/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	1,300	1,259	195,172	2024/12/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.1000	2,300	2,169	336,290	2027/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	1,000	980	152,019	2029/06/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.6500	400	395	61,246	2027/12/01

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	4.0000	1,100	1,122	173,983	2035/04/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	1,300	1,341	208,002	2029/12/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.4000	1,700	1,809	280,516	2033/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.7000	1,900	1,941	301,002	2030/06/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	2,900	2,967	460,009	2026/09/15
フィンランド	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	4.0000	300	305	47,356	2025/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	203	31,585	2028/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	779	120,860	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	800	710	110,157	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	700	668	103,641	2026/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.3750	500	382	59,340	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	500	467	72,452	2027/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	300	275	42,644	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	800	720	111,738	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.2500	500	331	51,364	2040/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	400	340	52,806	2030/09/15
FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	300	280	43,487	2026/09/15	
オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	6.2500	1,000	1,130	175,295	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.1500	300	344	53,471	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.8500	800	839	130,093	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.8000	700	847	131,394	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	500	524	81,277	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.4000	1,000	980	152,008	2034/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.2000	1,000	974	151,121	2025/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	600	572	88,748	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	700	542	84,054	2047/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	700	658	102,031	2027/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	600	561	87,088	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	550	500	77,533	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	1,300	1,121	173,803	2030/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	900	553	85,743	2051/03/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	400	255	39,637	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.8500	250	120	18,655	2120/06/30
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	1,400	1,173	181,956	2031/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	300	288	44,794	2025/04/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.9000	1,000	881	136,581	2032/02/20	
小 計			—	376,490	357,127	55,354,836	—
合 計			—	—	—	167,751,148	—

※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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2023年12月18日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 167,751,148	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,890,403	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	169,641,551	100.0

※期末における外貨建資産（169,248,477千円）の投資信託財産総額（169,641,551千円）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=142.20円、1カナダ・ドル=106.29円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1シンガポール・ドル=106.76円、1
 ニュージーランド・ドル=88.51円、1イギリス・ポンド=180.35円、1イスラエル・シケル=38.653円、1デンマーク・クローネ=
 20.79円、1ノルウェー・クローネ=13.56円、1スウェーデン・クローナ=13.84円、1メキシコ・ペソ=8.255円、1オフショア・人民
 元=19.944円、1マレーシア・リンギット=30.454円、1ポーランド・ズロチ=35.751円、1ユーロ=155.00円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年12月18日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	169,641,551,799円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	671,374,841
公 社 債(評価額)	167,751,148,322
未 収 利 息	1,128,403,094
前 払 費 用	90,625,542
(B) 負 債	320,373,497
未 払 解 約 金	320,372,665
そ の 他 未 払 費 用	832
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	169,321,178,302
元 本	78,931,509,804
次 期 繰 越 損 益 金	90,389,668,498
(D) 受 益 権 総 口 数	78,931,509,804口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,452円

※当期における期首元本額77,954,604,200円、期中追加設定元本額13,718,817,238円、期中一部解約元本額12,741,911,634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2022年12月20日 至2023年12月18日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,826,907,112円
受 取 利 息	3,827,275,726
そ の 他 収 益 金	1,937
支 払 利 息	△ 370,551
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,785,937,714
売 買 益	11,332,436,647
売 買 損	△ 2,546,498,933
(C) そ の 他 費 用 等	△ 59,239,844
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	12,553,604,982
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	76,746,905,619
(F) 解 約 差 損 益 金	△13,190,385,331
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	14,279,543,228
(H) 合 計(D+E+F+G)	90,389,668,498
次 期 繰 越 損 益 金(H)	90,389,668,498

※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	26,888,589,360円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	11,725,777円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	964,663,501円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	4,596,004円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,399,078,160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>	4,831,010,615円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,439,747,460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>	22,646,222円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	164,716,444円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	4,326,213,814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)	5,708,133円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,634,307,384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)	25,193,200円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,651,594,539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)	95,498,475円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	28,565,773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)	290,467,200円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	68,538,172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)	215,136,777円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	648,783,265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)	347,064,911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>	103,087,222円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	21,141,090円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	877,986,063円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	43,377,211円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,228,213,127円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	66,220,051円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,193,960,782円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	41,498,716円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,630,935,406円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	35,264,167円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	354,339,094円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	6,250,771,023円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	233,462,601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)	291,829,347円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	649,008,193円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	101,932,994円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	198,655,965円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	56,153,532円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	101,696,493円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	29,749,375円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	218,970,977円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,741,981円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	997,087,996円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	64,344,790円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	38,798,410円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	332,102,114円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	132,136,326円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	72,005,110円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	94,021,737円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,643,421円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,212,067円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,511,845円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	2,941,292,811円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	784,921,718円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	278,259,720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>	480,319,360円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	433,191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>	646,166,262円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	311,836円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	251,747,031円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	285,927円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	213,172,000円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	140,211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>	122,573,223円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	169,690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>	58,871,718円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	617,466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>	94,549,143円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	7,552,267円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	282,430,807円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	26,445,432円	三井住友・ニュー・アジア・ファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	158,940,863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21期（2022年12月1日から2023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TOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、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
	騰落率	中率	騰落率	中率			
17期（2019年12月2日）	円	%		%	%	%	百万円
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
20期（2022年11月30日）	34,074	5.8	3,249.61	5.7	97.9	2.0	222,819
21期（2023年11月30日）	41,803	22.7	3,986.65	22.7	98.3	1.6	282,638

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年11月30日	円 34,074	% —	3,249.61	% —	% 97.9	% 2.0
12月末	32,519	△ 4.6	3,101.25	△ 4.6	98.8	1.2
2023年 1 月末	33,956	△ 0.3	3,238.48	△ 0.3	98.9	1.0
2 月末	34,276	0.6	3,269.12	0.6	99.0	1.0
3 月末	34,858	2.3	3,324.74	2.3	97.6	2.4
4 月末	35,797	5.1	3,414.45	5.1	97.8	2.2
5 月末	37,089	8.8	3,537.93	8.9	98.1	1.9
6 月末	39,894	17.1	3,805.00	17.1	98.4	1.6
7 月末	40,492	18.8	3,861.80	18.8	98.9	1.3
8 月末	40,665	19.3	3,878.51	19.4	98.9	1.2
9 月末	40,879	20.0	3,898.26	20.0	98.1	1.9
10月末	39,655	16.4	3,781.64	16.4	97.8	2.2
(期 末) 2023年11月30日	41,803	22.7	3,986.65	22.7	98.3	1.6

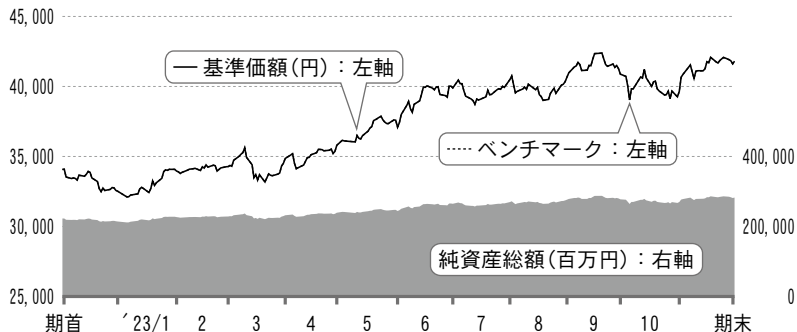
※騰落率は期首比です。

※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（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	34,074円
期末	41,803円
騰落率	+22.7%

※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、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（2022年12月1日から2023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

- ・日銀の金融緩和方針維持による円安進展や海外投資家による日本株買いが好感されたこと
- ・日銀による長短金利操作の運用柔軟化の決定が順調に消化され円安が進んだこと

下落要因

- ・FOMC（米連邦公開市場委員会）を契機に金融引き締めが長期化するとの見方から長期金利（10年国債利回り）が上昇したこと
- ・中東での地政学リスク台頭により原油価格急騰に対する警戒感が高まったこと

▶ 投資環境について（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

国内株式市場は上昇しました。

期初はFRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利見通しの上方修正を受けた利上げ長期化懸念や、米経済指標悪化を受けた景気後退懸念などから軟調な展開となりました。

年が明けると、米国でのインフレと利上げペース鈍化への期待や、国内でのコロナ禍からの経済活動再開への期待が支えとなりじり高の展開となりました。しかし、3月に米国での銀行破綻に欧州大手金融機関の経営不安の報道が重なったことで金融不安が広がると、欧米でリスク回避の動きが強まり、急落しました。

新年度に入ると、日銀の金融緩和方針維持による円安進展や海外投資家による日本株買いが好感され、上値を追う動きとなりました。夏場に、日銀による長短金利操作の運用柔軟化が決定されると、米ドル高・円安の流れが一段進みTOPIXはバブル後の高値を更新しました。

期末には、FOMCを契機に金融引き締めが長期化するとの見方から長期金利が上昇したことや、中東での地政学リスク台頭により原油価格急騰に対する警戒感が高まったことなどを背景に、国内も軟調に推移しました。日銀が金融政策決定会合で長短金利操作の再修正を決定すると、値動きが荒くなる場面がありましたが、同内容を消化後は、堅調な展開に回帰しました。

▶ ポートフォリオについて（2022年12月1日から2023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

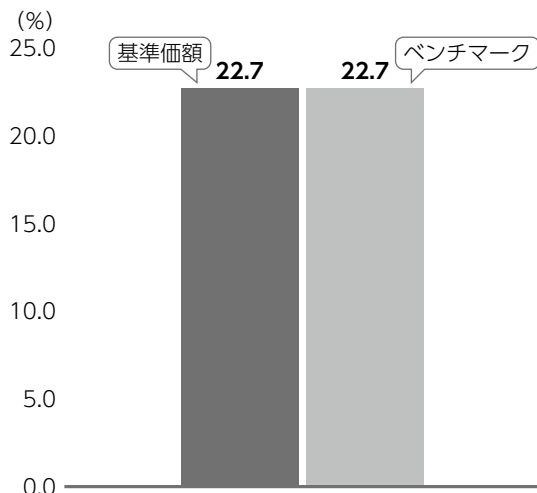
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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（2022年12月1日から2023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。記載のグラフは、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+22.7%となり、ベンチマークの騰落率+22.7%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（2022年12月1日から2023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)	0.002% (0.000) (0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 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	0.002	

期中の平均基準価額は37,388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12月1日から2023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 11,978.5 (30,542.116)	千円 26,323,582 (-)	千株 6,907.916	千円 11,231,079

※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。

(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 49,745	百万円 50,698	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

（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	37,554,661千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	248,112,176千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.15

※(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12月1日から2023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 9,992	百万円 26,323	38.0	百万円 2,481	百万円 11,231	22.1
株 式 先 物 取 引	696	49,745	1.4	711	50,698	1.4

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	百万円 250	百万円 75	百万円 4,187

(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	5,440千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	47千円
(c) (b)／(a)	0.9%

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

（2022年12月1日から2023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（2023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		千円	
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	3.9	4.1	15,703	
ニッスイ	106.9	115.6	85,243	
マルハニチロ	16.2	17.1	48,564	
雪国まいたけ	10.6	11.4	10,830	
カネコ種苗	5.3	4.7	6,683	
サカタのタネ	13.5	13.2	52,602	
ホクト	9.4	10.1	17,715	
鉱業 (0.4%)				
住石ホールディングス	21.8	14.4	11,116	
日鉄鉱業	4.3	4.5	25,425	
三井鉱山ホールディングス	5	5.5	15,499	
I N P E X	394	427.2	892,848	
石油資源開発	12.3	13.3	75,677	
K & O エナジーグループ	4.9	5.5	12,039	
建設業 (2.1%)				
ショーボンドホールディングス	14.5	15.7	94,592	
ミライト・ワン	37.2	38.1	70,351	
タマホーム	7.6	7.3	25,404	
日本アクア	5.9	5	4,675	
安藤・間	61.9	66.3	72,399	
東急建設	32.6	32.3	25,452	
コムシスホールディングス	35.9	37.5	120,262	
ビーアールホールディングス	22.2	21.6	7,754	
高松コンストラクショングループ	7.2	7.2	18,986	
東建コーポレーション	3.4	3.2	25,920	
ヤマウラ	7.6	6.9	9,922	
オリエンタル白石	41.3	44	14,520	
大成建設	74.2	75.7	380,846	
大林組	265.9	288.9	360,402	
清水建設	223.6	233.6	226,965	
飛島建設	10.4	9.6	12,470	
長谷工コーポレーション	76.9	83	150,935	
松井建設	2.7	8.2	6,355	
銭高組	2.1	1.5	5,775	
鹿島建設	164.9	179.1	418,467	
不動テトラ	6	5.6	12,258	
大末建設	3.7	—	—	
鉄建建設	7	6.7	13,085	
西松建設	13.1	13.9	54,404	
三井住友建設	63.2	65.6	26,108	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
大豊建設	3.3	3.6	13,140	
奥村組	12.3	12.9	58,243	
東鉄工業	10.3	10.9	31,631	
浅沼組	6.3	6.4	23,648	
戸田建設	92.7	99.9	84,345	
熊谷組	13	13.4	45,560	
北野建設	3	1.9	5,890	
矢作建設工業	11.3	11.5	14,789	
ピーエス三菱	11.1	10.9	10,256	
日本ハウスホールディングス	17.8	19.5	6,357	
新日本建設	10.7	11.5	12,776	
東亜道路工業	1.7	3.4	22,746	
日本道路	1.7	8.5	16,124	
東亜建設工業	6.8	7.1	25,382	
日本国土開発	23.7	24.3	14,312	
若築建設	3.8	3.9	11,489	
東洋建設	24.8	26.3	34,979	
五洋建設	106.9	114.6	92,871	
世紀東急工業	11.2	10.8	17,971	
福田組	2.9	3.1	16,182	
住友林業	57.2	69.7	263,047	
日本基礎技術	—	7.5	3,375	
巴コーポレーション	15.1	11.5	6,440	
大和ハウス工業	208.4	223.5	938,476	
ライト工業	13.5	14.4	28,512	
積水ハウス	233.7	244.9	741,802	
日特建設	8	8.2	8,429	
ユアテック	16.6	17.8	17,853	
日本リーテック	6.3	7.7	9,678	
四電工	1.8	3.5	10,178	
中電工	10.1	11.5	27,956	
関電工	38.3	49	65,072	
きんでん	51.5	56.5	125,401	
東京エネシス	8.5	8.7	8,395	
トーエネック	2.7	2.9	12,310	
住友電設	6.9	7.4	18,921	
日本電設工業	11.9	13.2	26,716	
エクシオグループ	36.4	36.8	114,742	
新日本空調	4.4	5.3	11,845	
九電工	18.3	19.7	91,861	
三機工業	16.2	16.9	29,575	
日揮ホールディングス	74.1	80	132,920	

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
中外炉工業	2.6	3.3	7,388	
ヤマト	10.1	7	6,587	
太平電業	4.8	5	19,375	
高砂熱学工業	17.8	19.3	57,880	
三晃金属工業	—	1.3	6,110	
朝日工業社	3.5	4	11,192	
明星工業	14	16	17,920	
大気社	8.9	9.2	38,916	
ダイダン	5.1	10.6	15,688	
日比谷総合設備	6.8	6.9	16,270	
テスホールディングス	8.7	18.2	8,044	
インフロンア・ホールディングス	78.4	86.9	135,694	
東洋エンジニアリング	11.2	11.3	7,977	
レイズネクスト	10.5	11.4	15,823	
食料品 (3.4%)				
ニッポン	19.4	21.4	48,663	
日清製粉グループ本社	69.1	75	153,637	
日東富士製粉	1.7	1.7	8,024	
昭和産業	6.2	6.7	20,502	
鳥越製粉	—	10.7	7,650	
中部飼料	10.8	11.3	12,260	
フィード・ワン	11.1	12.9	10,216	
日本甜菜製糖	5.3	5.2	10,467	
DM三井製糖ホールディングス	7.4	7.9	23,858	
ウェルネオシュガー	4.1	4.7	9,700	
森永製菓	15.6	15	79,155	
中村屋	2.9	2.8	8,596	
江崎グリコ	21.6	23.2	94,632	
名糖産業	1.6	—	—	
井村屋グループ	4.4	4.8	11,131	
不二家	5	5.7	14,255	
山崎製パン	50.5	54.6	176,631	
モロゾフ	2.7	2.8	10,878	
亀田製菓	4.8	5.1	19,813	
寿スピリッツ	8	43	100,964	
カルビー	34.5	37.3	103,283	
森永乳業	13.8	29.6	81,696	
六甲バター	5.9	6.3	8,719	
ヤクルト本社	53.5	116.2	383,808	
明治ホールディングス	46.3	99.5	340,588	
雪印メグミルク	18.6	19.5	42,178	
ブリマハム	9.9	10.6	23,850	
日本ハム	29.3	31.7	139,289	
丸大食品	8.6	8.4	13,582	
S Foods	8.4	8.9	28,524	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
柿安本店	3.2	3.3	8,170	
伊藤ハム米久ホールディングス	53.4	12.1	47,795	
サッポロホールディングス	24.8	26.7	153,952	
アサヒグループホールディングス	173.1	187.5	1,022,812	
キリンホールディングス	338.2	338.3	706,032	
宝ホールディングス	51	54.8	66,582	
オエノンホールディングス	25.6	26.2	9,798	
コカ・コーラ ボトラーズ	58.9	63.6	128,821	
ジャパンホールディングス	—	—	—	
ライフドリンク カンパニー	—	1.7	6,579	
ザントリー食品インターナショナル	52.5	57.1	265,400	
ダイドーグループホールディングス	4.2	4.5	26,910	
伊藤園	27.9	27.5	123,612	
キーコーヒー	8.5	8.4	17,371	
日清オイリオグループ	10.4	11.3	47,290	
不二製油グループ本社	17.7	18.9	43,885	
かどや製油	2.9	1.8	6,408	
J-オイルミルズ	7.8	8.3	16,375	
キッコーマン	49.5	53.7	486,790	
味の素	183.4	195.8	1,081,990	
ブルドックソース	3.5	4.7	9,832	
キュービー	40.2	43.6	112,488	
ハウス食品グループ本社	22.9	24.8	80,079	
カゴメ	35	36.4	115,642	
焼津水産化学工業	11.7	—	—	
アリアケジャパン	6.6	7.2	33,228	
エバラ食品工業	—	2.8	7,935	
ニチレイ	34.6	37.3	120,255	
東洋水産	37.8	41.1	323,457	
イトアンドホールディングス	3.9	4.1	8,384	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	—	5.8	6,461	
日清食品ホールディングス	26.6	28.6	419,419	
永谷園ホールディングス	4.1	4.2	9,109	
フジッコ	7.8	7.6	14,713	
ロック・フィールド	9.6	9.1	14,478	
日本たばこ産業	492.9	493.4	1,875,413	
ケンコーマヨネーズ	5.5	6.3	10,174	
わらべや日洋ホールディングス	6.1	6.2	21,607	
なとり	5.2	5.4	10,989	
ファーマフーズ	11.8	11.8	15,139	
ユーグレナ	49.3	51.5	38,419	
紀文食品	6.9	7.1	8,179	
ピックスホールディングス	1.5	5.2	6,276	
ミヨシ油脂	3.8	5.2	7,618	
理研ビタミン	6.8	7.2	16,221	

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
繊維製品 (0.4%)				
片倉工業	8.2	9	15,093	
グンゼ	5.8	5.9	28,320	
東洋紡	34.3	36.1	37,977	
ユニチカ	27.8	30.5	5,581	
富士紡ホールディングス	3.2	3.5	12,915	
倉敷紡績	6.1	6.6	16,876	
シキボウ	7.9	6.1	6,667	
日本毛織	22.2	21.8	28,231	
帝国繊維	9	9.3	18,869	
帝人	73.5	79.7	107,236	
東レ	511.5	554.1	425,050	
アツギ	3	—	—	
ダイニック	6.3	6.3	4,567	
セーレン	14.7	16	37,120	
小松マテーレ	12.3	13.3	10,374	
ワコールホールディングス	14.9	15.3	49,801	
ホギメディカル	10.3	11.2	38,360	
T S Iホールディングス	29.1	28.5	22,059	
ワールド	10.4	10.8	17,604	
三陽商会	4	2.8	7,554	
オンワードホールディングス	52.1	54.6	27,354	
ルックホールディングス	3.4	2.6	6,455	
ゴールドウイン	13.4	14.7	169,564	
デサント	13.1	14.3	60,846	
パルプ・紙 (0.2%)				
特種東海製紙	4.3	4	14,860	
王子ホールディングス	316.8	344.4	189,144	
日本製紙	40.3	43.6	58,293	
北越コーポレーション	48.3	51	71,859	
大王製紙	34.2	37	38,757	
レンゴー	70.5	75.9	71,004	
トーモク	5.4	5.4	11,739	
ザ・バック	6	6.2	19,933	
化学 (6.0%)				
北の達人コーポレーション	34.5	37.7	7,841	
クラレ	121	122.3	184,000	
旭化成	475.3	531.9	545,995	
レゾナック・ホールディングス	73.7	79.7	219,972	
住友化学	562.9	611.8	230,954	
住友精化	3.3	3.5	17,675	
日産化学	36.1	38.9	209,787	
ラサ工業	3.4	3.5	7,462	
クレハ	6.5	6.8	58,820	
多木化学	3	3.3	10,428	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
テイカ	5.4	5.9	7,817	
石原産業	14.3	14.8	20,320	
日本曹達	8.2	8.8	46,992	
東ソー	101.2	110	216,370	
トクヤマ	25	26.6	63,866	
セントラル硝子	12.3	13.3	36,162	
東亜合成	38.8	41.1	55,896	
大阪ソーダ	4.6	5.1	49,572	
関東電化工業	15.3	16.4	13,612	
デンカ	27.7	30.1	79,614	
信越化学工業	130.3	743.1	3,873,037	
日本カーバイド工業	4.4	—	—	
堺化学工業	6.2	6.3	11,875	
第一稀元素化学工業	7.6	8	7,960	
エア・ウォーター	71.8	78	151,437	
日本酸素ホールディングス	73.3	80	310,640	
日本化学工業	3.2	3	6,087	
日本パーカライジング	36.6	39.8	45,929	
高压ガス工業	12	12.8	10,355	
四国化成ホールディングス	9.2	11	19,217	
戸田工業	—	2.1	3,427	
ステラ ケミファ	4.8	5	16,225	
保土谷化学工業	2.5	2.4	8,640	
日本触媒	11.6	12.6	67,422	
大日精化工業	5.7	5.8	12,858	
カネカ	17.2	21	77,973	
三菱瓦斯化学	56.5	63	147,262	
三井化学	63.7	69	298,632	
J S R	71.2	77.2	314,126	
東京応化工業	13.3	13.3	121,867	
大阪有機化学工業	5.9	6.8	18,149	
三菱ケミカルグループ	515.3	582.5	564,151	
K Hネオケム	12.7	13.3	30,457	
ダイセル	112.2	117.4	166,825	
住友ベークライト	11.2	12.2	86,144	
積水化学工業	157.2	167	350,783	
日本ゼオン	45.7	56	76,944	
アイカ工業	19.2	20.7	68,827	
U B E	39.3	42.3	98,284	
積水樹脂	10.7	11.3	28,317	
タキロンシーアイ	16.8	18.9	11,132	
旭有機材	5.2	5.5	23,320	
ニチバン	5.3	5.7	10,020	
リケンテクノス	17.4	18.2	15,797	
大倉工業	4	4	11,272	

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
群栄化学工業	2.2	2.1	6,478	
ミライアル	3.6	2.7	4,101	
ダイキョーニシカワ	17.4	18.6	14,322	
森六ホールディングス	4.4	4.4	13,024	
恵和	2.5	6.1	8,296	
日本化薬	58.1	64	86,400	
カーリットホールディングス	8.5	8.7	8,221	
日本精化	4.3	4.8	12,840	
扶桑化学工業	6.9	7.5	32,887	
トリケミカル研究所	10.3	11	38,610	
ADEKA	26.2	30	86,085	
日油	23.5	25.5	174,547	
新日本理化	19.1	15.6	3,042	
ハリマ化成グループ	6.6	5.8	4,611	
花王	185.7	186.9	1,064,582	
第一工業製薬	3.4	3.3	6,184	
石原ケミカル	4.1	4.2	8,320	
ニイタカ	2.1	—	—	
三洋化成工業	4.5	4.8	20,568	
大日本塗料	11.8	10.8	10,594	
日本ペイントホールディングス	336.9	438.6	484,433	
関西ペイント	70	81	182,412	
中国塗料	14.9	13.8	21,265	
日本特殊塗料	6.2	5.2	6,598	
藤倉化成	4	12.9	5,753	
太陽ホールディングス	11.5	12.3	36,777	
DIC	29.7	33	80,305	
サカタインクス	17	18.3	23,918	
東洋インキSCホールディングス	14.3	17.2	45,872	
T&K TOKA	7.4	—	—	
富士フイルムホールディングス	146.3	156.4	1,354,424	
資生堂	159.4	172.7	684,928	
ライオン	92.1	108.6	140,528	
高砂香料工業	5.2	5.6	19,684	
マンダム	17	17.9	22,804	
ミルボン	11.4	11.7	43,243	
ファンケル	33.4	36.3	82,655	
コーセー	15.5	16.8	175,812	
コタ	6.3	8	12,576	
ポーラ・オルビスホールディングス	39.3	42.6	66,392	
ノエビアホールディングス	6.8	7.3	38,106	
新日本製薬	4.8	5	7,875	
l-o-n-e	—	1.1	2,842	
アクシージア	—	4.8	4,881	
エステー	6.6	7.1	10,770	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
アグロ カネショウ	—	3.9	5,257	
コニシ	12.6	13.7	35,373	
長谷川香料	15.7	15.8	50,876	
小林製薬	23.3	24.1	164,362	
荒川化学工業	7.5	7.7	7,838	
メック	6.3	6.7	27,101	
日本高純度化学	2.4	2.4	6,000	
タカラバイオ	20.5	22.2	27,128	
JCU	8.6	9.2	36,340	
新田ゼラチン	5.9	6	4,704	
OATアグリオ	3.5	2.7	5,200	
デクセリアルズ	22.1	23	106,559	
アース製薬	6.9	7.4	35,372	
北興化学工業	9.7	9.6	9,360	
大成ラミック	3.9	3.5	10,269	
クミアイ化学工業	30.7	33.1	36,045	
日本農薬	14.5	15.9	9,508	
アキレス	6	5.7	8,874	
有沢製作所	13	14.4	15,768	
日電東工	55.2	55.9	587,788	
レック	11.8	12.8	12,723	
三光合成	12.5	11.7	6,318	
きもと	19.4	21.6	4,125	
藤森工業	5.9	6.3	24,475	
前澤化成工業	6.2	5.9	9,322	
未来工業	3.2	3.2	10,064	
JSP	5.6	6	10,698	
エフピコ	14.6	15.9	44,376	
天馬	6.4	6.4	14,950	
信越ポリマー	13.8	14.8	21,149	
東リ	9.1	20	6,760	
ニフコ	27.4	29.8	107,637	
バルカー	6.5	6.8	26,554	
ユニ・チャーム	159	172.4	821,141	
医薬品（4.7%）				
協和キリン	91.8	103	251,011	
武田薬品工業	675	731.8	3,047,947	
アステラス製薬	730.9	736.4	1,323,679	
住友ファーマ	56.9	61.9	28,969	
塩野義製薬	97.6	104.5	729,201	
日本新薬	18	23	122,613	
中外製薬	238.5	258.8	1,350,418	
科研製薬	13.3	16	54,048	
エーザイ	92.9	100.6	771,803	
ロート製薬	37	82	253,380	

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
小野薬品工業	147.3	177	481,617	
久光製薬	17.2	19.5	90,051	
持田製薬	8.9	11	36,905	
参天製薬	1.44	155	216,845	
扶桑薬品工業	3.2	4	7,628	
ツムラ	24.1	28	78,260	
キッセイ薬品工業	11.8	15.5	47,352	
生化学工業	13.5	15.9	12,592	
栄研化学	11.9	17	27,999	
鳥居薬品	4	5	18,300	
JCRファーマ	26.2	28.5	37,734	
東和薬品	11.9	12.7	31,369	
富士製薬工業	6.6	7.9	12,324	
ゼリア新薬工業	10.5	11.3	22,893	
モーせいグループ	—	26.9	37,364	
第一三共	664.4	720.4	2,881,600	
杏林製薬	16.6	17.4	31,807	
大幸薬品	15.9	18.1	5,448	
ダイト	5.4	8	15,560	
大塚ホールディングス	174.4	172.5	981,352	
大正製薬ホールディングス	17.5	—	—	
ペプチドリーム	37.4	45	56,992	
あすか製薬ホールディングス	8.4	9.7	17,663	
サワイグループホールディングス	17.4	20	98,360	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	81.6	83.3	10,162	
ニチレキ	9.4	9.6	21,945	
ユシロ化学工業	10.5	5.8	9,964	
富士石油	20	22.1	8,066	
出光興産	84.4	91.6	371,529	
Eneosホールディングス	1,378.6	1,317.1	769,713	
コスモエネルギーホールディングス	29	25	140,875	
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	43.3	42.2	138,795	
TOYO TIRE	44.1	47.4	116,343	
ブリヂストン	243.5	241.6	1,473,276	
住友ゴム工業	75.2	81.1	138,640	
藤倉コンポジット	6.6	—	—	
オカモト	4.5	4.1	22,345	
フコク	—	5	7,010	
ニッタ	7.6	8.2	30,709	
住友理工	15.6	13.8	14,269	
三ツ星ベルト	11.3	11.3	50,454	
バンドー化学	12.7	12.7	19,812	
ガラス・土石製品 (0.7%)				
日東紡績	9.4	10.5	47,197	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
AGC	77.4	74	397,380	
日本山村硝子	—	2.4	3,616	
日本電気硝子	31.5	33.5	104,520	
オハラ	5	5.3	6,964	
住友大阪セメント	11.3	11.8	42,574	
太平洋セメント	49.1	52.6	146,096	
日本ヒューム	9.5	11	10,439	
日本コンクリート工業	22.5	21.5	6,944	
三谷セキサン	3.6	4	17,560	
アジアパイルホールディングス	15.1	18.5	13,024	
東海カーボン	64.8	76.3	83,472	
日本カーボン	4.6	4.9	22,760	
東洋炭素	4.9	6.1	27,999	
ノリタケカンパニーリミテド	4.2	4.8	33,312	
TOTO	50.2	54.5	206,936	
日本碍子	89.7	95.9	173,003	
日本特殊陶業	58.2	65.2	223,831	
ダントーホールディングス	—	5	4,795	
MARUWA	3	3.2	95,264	
品川リフラクトリーズ	2.3	13	22,165	
黒崎播磨	1.8	2	22,460	
ヨータイ	5	6.2	9,027	
東京窯業	22.5	13.6	5,725	
フジミインコーポレーテッド	6.5	22	64,438	
ニチアス	20	22	69,410	
ニチハ	9.9	10.5	29,148	
鉄鋼 (1.0%)				
日本製鉄	351.2	380.8	1,316,425	
神戸製鋼所	173	171	296,086	
中山製鋼所	17.3	18	15,174	
合同製鐵	4.4	4	18,240	
JFEホールディングス	215	237	516,660	
東京製鐵	21.9	24.1	43,235	
共英製鋼	13	9.6	19,968	
大和工業	14.8	15.5	115,661	
東京製鋼	4.5	4.3	17,028	
大阪製鐵	5.6	5.3	10,107	
淀川製鋼所	8.4	9.3	36,316	
中部鋼板	—	7.3	14,337	
丸一鋼管	27.2	25.7	98,199	
モリ工業	2.8	2	8,370	
大同特殊鋼	12	10.7	73,048	
日本冶金工業	5.9	6.2	25,916	
山陽特殊製鋼	7.6	8.2	21,451	
愛知製鋼	7	5.1	17,518	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本金属	—	3.6	3,286	
大太平洋金属	8	6.3	7,774	
新日本電工	52.1	50.9	15,422	
栗本鐵工所	4.4	4.6	15,364	
三菱製鋼	6.1	5.8	8,926	
日本精線	2	1.3	6,116	
エンビプロ・ホールディングス	10	—	—	
新家工業	3.1	2	5,786	
非鉄金属（0.7%）				
大紀アルミニウム工業所	11.1	12.2	14,725	
日本軽金属ホールディングス	21.7	23.9	40,367	
三井金属鉱業	22.9	25.2	114,408	
東邦亜鉛	5.1	—	—	
三菱マテリアル	52.6	61.8	150,421	
住友金属鉱山	91.1	98.8	424,049	
DOWAホールディングス	17.9	20.5	107,748	
古河機械金属	11.1	12.9	24,148	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11.7	14.4	41,788	
東邦チタニウム	14.4	16.5	30,211	
UACJ	11.1	12	41,580	
CKサンエツ	2.2	2.4	8,868	
古河電気工業	26.3	28.8	68,500	
住友電気工業	270.6	319	585,046	
フジクラ	85.3	99.1	112,825	
SWCC	8.9	9.7	26,005	
タツタ電線	16.1	—	—	
平河ヒューテック	5	5.5	7,502	
リョービ	8.9	9.3	27,109	
アーレスティ	—	8.5	6,944	
AREホールディングス	31.7	34.6	66,051	
金属製品（0.5%）				
稲葉製作所	8.9	6.2	9,213	
宮地エンジニアリンググループ	2.5	4.8	15,288	
トーカロ	21.4	22.1	31,779	
アルファ	7.4	4.2	6,228	
SUMCO	149.4	151.1	334,913	
川田テクノロジーズ	2.2	2.3	16,100	
RS Technologies	2.6	5.9	16,885	
ジェイテックコーポレーション	—	1.2	2,448	
信和	11.2	9.9	7,326	
東洋製罐グループホールディングス	52	50.9	116,790	
ホッカンホールディングス	5.8	5.5	8,662	
横河ブリッジホールディングス	10.3	10.5	28,602	
三和ホールディングス	72	80.4	170,528	
文化シャッター	22.6	24	33,120	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
三協立山	12.5	10.7	8,752	
アルインコ	7.5	7.6	7,767	
LIXIL	114.2	130.3	235,256	
ノーリツ	11.7	13.8	20,672	
長府製作所	7.9	8.4	17,656	
リンナイ	14.2	46.2	138,831	
日東精工	12.5	13.7	7,726	
岡部	14.2	16.5	11,599	
ジーテクト	8.6	9.3	16,219	
東プレ	13.9	14.9	29,829	
高周波熱錬	14.5	14	14,042	
東京製鋼	5.8	5.7	7,866	
サンコール	8.4	—	—	
モリテックスチール	8.8	—	—	
パイオラックス	11.1	11.6	26,274	
エイチワン	—	9.6	7,372	
日本発条	69.5	75.1	84,487	
中央発條	—	4	2,888	
立川ブラインド工業	—	4.6	6,826	
三益半導体工業	7	6.4	17,766	
機械（5.2%）				
日本製鋼所	21.4	22.9	58,475	
三浦工業	32.2	34.6	99,163	
タクマ	24	25.2	41,126	
ツガミ	17.4	18	22,140	
オークマ	7.7	8.1	50,171	
芝浦機械	8.7	8.3	31,664	
アマダ	121.6	131.5	194,948	
アイダエンジニアリング	16.3	16.4	14,268	
FUJII	33.3	35.8	89,714	
牧野フライス製作所	8.5	9.1	52,780	
オーエスジー	36.9	38.2	70,326	
旭ダイヤモンド工業	23.1	23.1	21,228	
DMG森精機	46.8	50.2	133,356	
ソディック	21	22.4	16,822	
ディスコ	12.3	40.1	1,286,809	
日東工器	4.4	4.4	8,192	
日進工具	6.7	7.1	7,313	
パンチ工業	3.3	—	—	
豊和工業	6.5	5.5	4,262	
石川製作所	3.5	3.1	3,729	
リケンNPR	—	7	13,720	
島精機製作所	12.3	13.5	20,709	
オプトラン	11.6	13.7	22,289	
NCホールディングス	2.5	2	3,804	

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
イワキ	5.7	6.3	12,959	
フリー	8.9	9.2	11,334	
ヤマシンフィルタ	20.4	21.8	7,521	
日阪製作所	9.1	8.8	8,421	
やまびこ	13.1	13.3	19,763	
野村マイクロ・サイエンス	2.6	2.8	32,004	
平田機工	3.8	4	25,520	
PEGASUS	9.6	11	5,258	
マルマエ	4.2	4.3	7,851	
タツモ	5	5.2	18,928	
ナプテスコ	48.4	52.1	144,186	
三井海洋開発	9.9	10.6	20,214	
レオン自動車	8.7	9.1	14,214	
SMC	24.9	25.2	1,876,140	
ホソカワミクロン	6.1	5.7	24,225	
ユニオンツール	3.3	3.6	12,186	
瑞光	—	6.5	9,314	
オイレス工業	10.9	11.1	21,689	
日精エー・エス・ビー機械	3.6	3.4	16,949	
サトーホールディングス	11.1	11.6	23,652	
技研製作所	8.2	8.1	15,049	
日本エアーテック	5.3	5.1	7,140	
日精樹脂工業	7.2	6.9	7,479	
オカダアイオン	1.4	—	—	
ワイエイシイホールディングス	4.1	2.7	6,831	
小松製作所	360	390	1,471,080	
住友重機械工業	45.3	48.9	172,568	
日立建機	30.6	33	126,555	
日工	13.7	12.8	8,614	
巴工業	4	3.8	10,928	
井関農機	8.5	8.4	9,290	
TOWA	8.1	8.4	59,304	
ローテ	4	4.3	62,608	
クボタ	406.5	436.6	925,155	
荏原実業	4	4.5	13,284	
三菱化工機	3.1	2.9	9,526	
月島ホールディングス	11.6	11.5	15,272	
帝国電機製作所	6.1	5.9	17,788	
新東工業	17.1	16.7	18,152	
澁谷工業	7.2	8	20,296	
アイチ コーポレーション	11.5	11.8	11,009	
小森コーポレーション	19.2	19.3	22,561	
鶴見製作所	6.1	6.3	22,459	
酒井重工業	1.8	1.4	8,218	
荏原製作所	31.4	34	284,614	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
西島製作所	7.7	7.6	16,697	
北越工業	8.8	8.7	19,566	
ダイキン工業	91.7	99.2	2,197,776	
オルガノ	10.5	11.5	69,690	
トーヨーカネツ	3.7	3.4	12,631	
栗田工業	42.9	46.5	243,567	
椿本チエイン	10.6	11.5	43,412	
大同工業	7.9	6.3	4,643	
木村化工機	8.6	8.7	6,229	
アネスト岩田	13.9	14.1	15,425	
ダイフク	39.6	134.8	375,148	
サムコ	2.7	2.3	11,005	
加藤製作所	—	4.3	5,362	
タダノ	41.4	47.5	54,838	
フジテック	28.2	24.6	84,353	
CKD	21.3	23.9	57,575	
平和	25.8	27.7	58,280	
理想科学工業	7	7.2	19,879	
SANKYO	15.3	19.2	122,649	
日本金銭機械	10.5	9.9	11,097	
マースグループホールディングス	5.5	5.1	12,153	
フクシマガリレイ	5.7	6.1	29,890	
ダイコク電機	5.4	4.7	16,238	
竹内製作所	14	15.1	65,307	
アマノ	22	23.6	74,269	
JUKI	13.8	13.7	6,918	
ジャノメ	9.8	9.4	6,739	
マックス	9.4	10.5	29,547	
グローリー	20.4	20.1	55,677	
新晃工業	8.3	8.2	20,327	
大和冷機工業	11.6	12.4	17,880	
セガサミーホールディングス	62	70.3	150,969	
日本ピストンリング	1.2	—	—	
リケン	3.8	—	—	
TPR	9.8	9.3	16,079	
ツバキ・ナカシマ	18	19.1	14,172	
ホシザキ	49.5	49.7	234,037	
大豊工業	8	8.3	7,245	
日本精工	141.2	140	108,514	
NTN	155.1	163.4	45,245	
ジェイテクト	68	73.4	99,493	
不二越	5.7	6.3	23,845	
日本トムソン	20.4	20.6	12,154	
THK	44.4	47.8	141,177	
ユースン精機	—	7.7	5,174	

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
前澤給装工業	6.8	6.3	8,133	
イーグル工業	9.2	9.3	15,410	
前澤工業	—	5.6	5,482	
日本ピラー工業	7.3	7.8	35,880	
キッツ	29	30	34,290	
マキタ	95.9	97.9	384,159	
三井E&S	—	40.7	22,100	
日立造船	63.5	68.1	61,358	
三菱重工業	134.5	145.3	1,201,340	
IHI	48.5	60	171,360	
スター精密	14.6	15.1	28,342	
電気機器 (17.3%)				
日清紡ホールディングス	63.3	65.2	70,839	
イビデン	44	43.7	309,002	
コニカミノルタ	173.4	186.2	87,122	
ブラザー工業	102.2	111.3	277,804	
ミネベアミツミ	133	144.4	406,197	
日立製作所	385.5	400	4,114,000	
東芝	147.9	—	—	
三菱電機	793.7	916	1,840,244	
富士電機	46.6	50.6	313,770	
東洋電機製造	—	5	4,680	
安川電機	90.9	91.5	519,079	
シンフォニアテクノロジー	9.2	10	20,640	
明電舎	12	12.5	30,587	
オリジン	3.7	3.5	4,256	
山洋電気	3.5	3.6	21,924	
デンヨー	6.6	6.9	14,904	
PHCホールディングス	10.9	11.6	17,226	
KOKUSAI ELECTRIC	—	32	106,080	
ソシオネクスト	7.5	12	159,000	
東芝テック	11.4	11.3	32,871	
芝浦メカトロニクス	1.5	4.5	30,150	
マブチモーター	19	20.7	96,213	
ニデック	186.6	183.9	1,030,575	
トレックス・セミコンダクター	3.9	4.1	8,216	
東光高岳	5.2	5.3	10,965	
ダブル・スコープ	19.5	24.1	22,172	
ダイヘン	7.1	7.4	43,142	
ヤーマン	15.7	15.2	16,127	
JVCケンウッド	75.6	67.7	51,925	
ミマキエンジニアリング	8.5	9	8,721	
IPEX	5.3	6.2	11,308	
日新電機	18.1	—	—	
大崎電気工業	21.4	21.5	14,125	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
オムロン	70.4	63.9	396,116	
日東工業	10.5	11.2	40,208	
I D E C	11.5	12.3	34,747	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	25.6	27.3	59,336	
メルコホールディングス	2.3	2.4	8,304	
日本電気	108.6	110.1	907,224	
富士通	76.5	76.6	1,617,792	
沖電気工業	36.6	37.5	35,850	
電気興業	4	3.7	8,946	
サンケン電気	7.2	7.7	58,173	
アイホン	5.1	4.9	13,563	
ルネサスエレクトロニクス	500.9	543	1,413,700	
セイコーエプソン	102.2	106.7	234,526	
ワコム	61.4	63.4	43,619	
アルバック	18.3	19.7	128,207	
アクセル	4	2.8	5,908	
E I Z O	5.8	6.1	29,737	
日本信号	17.8	19	18,183	
京三製作所	19.4	19.5	9,282	
能美防災	10.4	11.2	21,112	
ホーチキ	6.4	6.7	11,075	
エレコム	18.5	19.9	32,317	
パナソニック ホールディングス	907.3	983.7	1,505,061	
シャープ	92.8	124.5	115,237	
アンリツ	54.6	59	75,726	
富士通ゼネラル	21.9	23.8	64,498	
ソニーグループ	537.9	582.3	7,465,086	
T D K	121.6	131.7	904,779	
帝国通信工業	4.3	4.1	8,052	
タムラ製作所	34.1	36.2	20,597	
アルプスアルパイン	69.6	74.6	96,644	
日本電波工業	9.6	10.8	13,500	
鈴木	3	5.5	6,787	
メイコー	8.6	9.1	39,630	
日本トリム	2.4	2.2	6,831	
ローランド ディー・ジー	4.5	4.6	16,629	
フォスター電機	9.1	8.7	9,674	
S M K	2.3	2.5	6,290	
ヨコオ	6.4	7.3	11,431	
ホシデン	18.7	19.3	34,894	
ヒロセ電機	12.7	12.7	210,185	
日本航空電子工業	15.7	16.9	49,804	
T O A	10.3	10.1	10,605	
マクセル	17.4	17.4	28,849	
古野電気	10.7	11.5	20,815	

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
スミダコーポレーション	8	11.3	13,356	
アイコム	3.2	3.6	11,736	
リオン	3.6	3.8	8,470	
横河電機	84	91.1	255,171	
新電元工業	3.2	3.4	10,387	
アズビル	53.1	57.6	274,867	
東亜ディーケーケー	7.6	6	5,280	
日本光電工業	35.3	36.7	136,230	
チノー	4.2	4	8,264	
日本電子材料	6.4	6.2	9,746	
堀場製作所	17	16.1	160,307	
アドバンテスト	59.8	236.3	1,106,120	
エスベック	6.6	7.1	16,770	
キーエンス	76.1	82.4	5,220,040	
日置電機	4	4.1	26,896	
シスメックス	65.5	71	580,851	
日本マイクロニクス	12.9	14.8	56,758	
メガチップス	6.5	6.8	28,764	
OBARA GROUP	4.4	4.9	18,130	
コーセル	11.5	10.6	13,398	
イリソ電子工業	7.1	7.6	30,210	
オブテックスグループ	14.3	15.1	25,851	
千代田インテグレ	4.3	3.7	11,248	
レーザーテック	37.5	37.8	1,248,912	
スタンレー電気	54	56.5	154,584	
岩崎電気	3.1	—	—	
ウシオ電機	40	41.8	79,629	
ハリオス テクノ ホールディング	11.5	6.3	3,150	
エノモト	2.5	—	—	
日本セラミック	8	8	23,472	
古河電池	6.2	6.5	5,798	
双信電機	2.8	—	—	
山一電機	7.1	7.3	13,833	
図研	6.7	7.2	30,528	
日本電子	19	20.6	120,757	
カシオ計算機	57.1	61.3	76,563	
ファナック	74.6	402.1	1,654,239	
日本シイエムケイ	18.6	19.8	14,869	
エンプラス	2.4	2.5	33,350	
大真空	10.2	10.8	9,158	
ローム	35.1	152.4	430,606	
浜松ホトニクス	60.8	66	386,496	
三井ハイテック	7.9	7.4	54,752	
新光電気工業	26.8	29.1	160,602	
京セラ	118.1	128	1,048,320	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
太陽誘電	37	40.1	153,743	
村田製作所	230.5	749.7	2,161,759	
双葉電子工業	17.6	17.4	9,622	
北陸電気工業	1.6	3.2	4,486	
ニチコン	15.9	16.8	24,712	
日本ケミコン	8.1	—	—	
K O A	11.8	12.6	20,399	
市光工業	12.9	15.9	8,570	
小糸製作所	91.1	92.2	206,205	
ミツバ	16.5	16.2	15,114	
S C R E E Nホールディングス	13	28.2	303,714	
キャノン電子	8.7	9.1	17,936	
キャノン	417.3	411.3	1,565,819	
リコー	190	206.9	249,728	
象印マホービン	22.7	23.5	36,566	
東京エレクトロン	53.6	174.3	4,187,557	
イノテック	6	6.1	10,546	
輸送用機器 (8.7%)				
トヨタ紡織	32	34.5	87,975	
ユニプレス	15	15.1	14,949	
豊田自動織機	55.3	68.4	869,706	
モリタホールディングス	14	14.6	22,279	
三櫻工業	12.5	14	12,222	
デンソー	156.7	679.6	1,572,594	
東海理化電機製作所	20.9	22.7	56,250	
川崎重工業	57.6	64	215,232	
名村造船所	—	16	16,464	
日本車輻製造	3.7	5	10,470	
三菱ロジスネクスト	14	14	18,536	
日産自動車	1,081.7	1,171.2	682,692	
いすゞ自動車	220.6	239.1	467,560	
トヨタ自動車	4,175.6	4,527	12,650,701	
日野自動車	99	106.9	51,034	
三菱自動車工業	297.8	322.3	155,155	
G M B	—	2	2,650	
武蔵精密工業	18.6	19.8	31,957	
日産車体	13.7	16	14,336	
新明和工業	24.7	25.9	30,665	
極東開発工業	13.7	13.3	25,270	
トビー工業	6.9	7.1	19,617	
ティラド	2.5	3	9,495	
曙ブレーキ工業	53.4	—	—	
タチエス	13.1	13.2	23,232	
N O K	30	32.2	60,697	
フタバ産業	24	24	20,544	

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
カヤバ	7.4	7.8	37,089	
大同メタル工業	19.6	19.5	11,290	
プレス工業	35.7	36.2	22,444	
ミクニ	13.5	10	4,560	
太平洋工業	17.9	18.4	25,704	
アイシン	58.3	63.5	346,138	
マツダ	252	272.5	430,141	
今仙電機製作所	—	6.3	3,868	
本田技研工業	618	2,010	3,033,090	
スズキ	139.8	151.4	911,579	
S U B A R U	241.1	260.9	683,818	
安永	—	4.4	3,115	
ヤマハ発動機	119.2	118.5	447,574	
T B K	18.5	—	—	
エクセディ	12.7	13	33,124	
豊田合成	22.2	23.8	70,400	
愛三工業	13.8	14	18,368	
日本プラスト	15.9	11	6,292	
ヨロズ	9	10	9,020	
エフ・シー・シー	13.4	14.2	25,957	
シマノ	31.1	33.5	762,292	
テイ・エス テック	34.9	37.5	68,475	
ジャムコ	2.4	4	5,952	
精密機器 (2.3%)				
テルモ	237.5	232.8	1,098,350	
日機装	19.5	19.1	19,214	
日本エム・ディ・エム	5	5.4	3,796	
島津製作所	92.3	102.2	391,937	
長野計器	6.4	6.2	12,914	
ブイ・テクノロジー	4.1	4.4	11,690	
東京計器	7	6.9	12,157	
愛知時計電機	3.8	3.8	8,937	
インターアクション	5.1	4.5	4,572	
オーバル	8	7.3	3,547	
東京精密	16.6	17.8	152,670	
マニー	33.6	33.2	72,807	
ニコン	118.4	119.2	169,800	
トプコン	40.3	43.5	65,989	
オリンパス	475.4	507.6	1,099,461	
理研計器	4.8	5.1	33,813	
タムロン	5.7	5.4	23,841	
H O Y A	164.3	164	2,733,060	
ノーリツ鋼機	7.3	7.9	23,644	
A&Dホロンホールディングス	11.1	11.9	22,253	
朝日インテック	100.5	92.1	264,004	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
シチズン時計	83.7	78.1	67,712	
リズム	3	1.7	4,234	
メニコン	26.2	28.4	61,173	
松風	3.7	4	10,692	
セイコーグループ	11.8	12.8	32,064	
ニプロ	64.5	69	77,142	
その他製品 (2.3%)				
スノーピーク	13.3	12.3	12,447	
バラムウントベッドホールディングス	17.3	18.9	52,220	
トランザクション	6.6	5.2	10,982	
ニホンフラッシュ	7.8	8.6	7,705	
前田工織	8.4	7	20,713	
永大産業	27.2	17.8	3,951	
アートネイチャー	8.9	9.8	7,742	
バンダイナムコホールディングス	69.4	225.4	663,352	
S H O E I	8	18.7	37,119	
フランスベッドホールディングス	10.6	10.5	13,135	
パイロットコーポレーション	11.9	12.4	55,415	
萩原工業	6.5	6.3	10,023	
フジシールインターナショナル	15.5	16.7	27,972	
タカラトミー	35.3	37.5	77,943	
広済堂ホールディングス	5.5	18	11,430	
プロネクサス	7.5	7.7	9,309	
ウッドワン	5	—	—	
大建工業	5	—	—	
TOPPANホールディングス	98.9	101.2	350,556	
大日本印刷	89.8	90.2	374,600	
共同印刷	2.7	2.8	10,080	
N I S S H A	14.6	15.1	22,272	
TAKARA & COMPANY	5.8	5.7	14,022	
アシックス	70.3	70.2	371,358	
ツツミ	—	2	4,288	
ローランド	5.7	6.2	28,148	
小松ウオール工業	3	3.3	9,659	
ヤマハ	47.8	51.9	179,625	
河合楽器製作所	2.2	2.4	7,572	
クリナップ	9.7	10.5	7,308	
ビジョン	49	53	87,927	
キングジム	7.9	9	7,830	
リンテック	15.2	16.3	40,652	
イトーキ	18.1	17.1	22,572	
任天堂	480.2	519.9	3,593,548	
三菱鉛筆	10.9	11.8	22,278	
タカラスタンダード	14.2	15.2	27,010	
コクヨ	36.5	36.5	84,041	

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
ナカバヤシ	3.3	—	—	—
グロープライド	6.2	6.8	13,763	
オカムラ	22.5	24.9	53,061	
美津濃	7.6	8.3	33,573	
電気・ガス業 (1.4%)				
東京電力ホールディングス	686.3	744.2	469,515	
中部電力	278.9	303	553,581	
関西電力	292.3	318.1	626,975	
中国電力	121.9	143.2	139,820	
北陸電力	73.7	83.4	60,239	
東北電力	186.2	216.3	204,814	
四国電力	65.8	75.3	77,031	
九州電力	174.3	189.6	187,817	
北海道電力	75.2	79.5	49,751	
沖縄電力	19.1	20.6	22,330	
電源開発	57.5	67.5	155,081	
エフオン	6.8	8.6	4,093	
イーレックス	13.5	15.1	9,950	
レノバ	20.3	22.2	23,421	
東京瓦斯	160.6	174.2	596,983	
大阪瓦斯	153.6	166.7	480,096	
東邦瓦斯	30	34.6	91,188	
北海道瓦斯	5	5.1	11,531	
広島ガス	13.7	19.1	7,143	
西部ガスホールディングス	7.1	7.8	14,609	
静岡ガス	17	18	18,360	
メタウォーター	9.4	9.8	20,080	
陸運業 (2.8%)				
SBSホールディングス	6.6	7.2	18,050	
東武鉄道	83.1	90.4	330,412	
相鉄ホールディングス	25.4	27.3	73,232	
東急	212.2	230.7	400,379	
京浜急行電鉄	86.6	93.4	117,870	
小田急電鉄	115	126.1	262,224	
京王電鉄	40.2	43.6	185,866	
京成電鉄	48.9	53.1	316,476	
富士急行	9.4	10.2	44,166	
東日本旅客鉄道	129.1	147.9	1,182,460	
西日本旅客鉄道	97.5	102.3	598,148	
東海旅客鉄道	58.7	317.5	1,127,125	
西武ホールディングス	92.4	99.9	178,271	
鴻池運輸	13.1	14	27,566	
西日本鉄道	20.2	21.6	51,138	
ハマキョウレックス	5.9	6.3	25,231	
サカイ引越センター	3.7	7.8	20,373	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
近鉄グループホールディングス	75.7	82.1	340,386	
阪急阪神ホールディングス	100.7	109.5	489,574	
南海電気鉄道	36.4	39.3	110,138	
京阪ホールディングス	31.4	45.4	167,616	
神戸電鉄	2.8	2.8	8,226	
名古屋鉄道	84	90.8	196,536	
山陽電気鉄道	6.3	6.7	14,224	
アルプス物流	6	6.7	10,807	
ヤマトホールディングス	97.2	105.4	277,043	
山九	19.3	20.9	105,315	
丸全昭和運輸	4.7	5	18,700	
センコーグループホールディングス	39.8	42.9	45,345	
トナミホールディングス	1.8	1.9	8,797	
ニッコンホールディングス	24.3	26.1	83,963	
福山通運	6.3	6.2	22,723	
セイノーホールディングス	47	47.1	98,109	
神奈川中央交通	2.5	2.6	7,917	
日立物流	16.7	—	—	
AZ-COM丸和ホールディングス	18.5	20	30,020	
C&Fロジホールディングス	7.8	8.3	12,541	
九州旅客鉄道	54.1	58.1	179,587	
SGホールディングス	145.4	145.5	311,006	
NIPPON EXPRESSホールディングス	28.1	28.3	228,409	
海運業 (0.8%)				
日本郵船	202	233.4	927,531	
商船三井	133.3	178.5	724,888	
川崎汽船	64.7	69.4	360,116	
NSユナイテッド海運	4.2	4.6	22,379	
明海グループ	9.3	7.4	5,120	
飯野海運	29	30.6	37,423	
乾汽船	10.6	11.6	14,082	
空運業 (0.5%)				
日本航空	185.8	201.9	567,540	
ANAホールディングス	207.3	224.6	685,479	
パスコ	3.2	—	—	
倉庫・運輸関連業 (0.1%)				
トランコム	2.2	2.4	18,144	
日新	6.3	6.5	16,315	
三菱倉庫	16.2	20	88,620	
三井倉庫ホールディングス	7.1	7.5	36,262	
住友倉庫	20.4	21.5	52,438	
澁澤倉庫	3.5	3.3	9,348	
東陽倉庫	27.4	3.7	5,616	
日本トランスシティ	16	16.8	10,449	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
川西倉庫	5.2		5.2		5,642
安田倉庫	—		6.5		7,312
東洋埠頭	0.9		—		—
上組	37.4		39		126,321
キムラユニティー	—		4.3		6,118
キューソー流通システム	6.6		6.3		5,682
エーアイティー	5.4		5.4		8,985
内外トランスライン	3.2		3.5		8,816
日本コンセプト	2.9		3.3		5,553
情報・通信業（7.7%）					
NECネットエスアイ	25.3		27.3		58,940
クロスキャット	4.8		5.2		5,860
システナ	126.9		138.2		40,907
デジタルアーツ	4.9		5.2		25,038
日鉄ソリューションズ	12.7		14		65,030
キューブシステム	5.7		5.6		6,227
コア	3.9		4.4		7,827
手間いらず	1.3		1.5		3,744
ラクーンホールディングス	8.5		8.1		5,516
ソリトンシステムズ	5.1		4.8		6,124
ソフトクリエイトホールディングス	3.4		7.1		12,034
T I S	85.4		90.4		282,680
グリー	41.9		23.3		13,234
コーエーテクモホールディングス	47.8		51.8		93,783
三菱総合研究所	3.7		3.9		18,739
ファインデックス	8		8.2		7,806
ブレインパッド	8.2		6.6		6,758
K L a b	17.2		18.4		5,115
ポルトゥウィンホールディングス	13.7		15		8,025
ネクソン	197.1		184.5		590,031
アイスタイル	25.3		26.4		11,563
エムアップホールディングス	9.6		10.8		10,994
エイチーム	7		6.7		4,582
エニグモ	11.2		12.7		4,864
コロプラ	30		31.5		19,183
ブロードリーフ	46.4		42.9		24,281
クロス・マーケティンググループ	4.2		5		2,835
デジタルハーツホールディングス	5.2		5.7		5,700
システム情報	7.4		—		—
メディアアドゥ	3.5		3.7		5,609
じげん	25.2		24.9		13,396
バイキューブ	10.2		—		—
サイバーリンクス	3.1		—		—
ディー・エル・イー	8.6		—		—
フィックスターズ	9.6		9.8		13,288

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
CARTA HOLDINGS	4.2		4.4		5,772
オブティム	7.3		7.2		6,091
セレス	—		3.8		3,477
S H I F T	5.6		5.5		189,420
ティーガイア	8.1		9		16,515
テクマトリックス	14.3		15.2		26,372
プロシップ	3.9		4.3		5,680
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	23.8		22		50,424
GMOペイメントゲートウェイ	17.4		16.5		143,665
システムリサーチ	2.7		2.8		10,052
インターネットイニシアティブ	42.4		41.6		110,531
さくらインターネット	11.1		9.6		17,193
ヴィンクス	1		—		—
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2.5		2.7		6,725
S R Aホールディングス	4.1		4.4		15,818
朝日ネット	9.4		9.6		6,019
e B A S E	12.1		12.2		9,833
アバントグループ	9.8		10.7		15,921
アドソル日進	4		3.8		6,102
フリービット	5.7		5.1		6,063
コムチュア	10.3		11		22,165
アステリア	7.5		—		—
アイル	4.4		4		14,280
マークライnz	4.5		4.7		12,995
メディカル・データ・ビジョン	12.2		12.6		8,744
g u m i	13.3		13.1		5,449
テラスカイ	3.6		3.9		6,107
デジタル・インフュメーション・テクノロジー	4.5		5.2		8,507
ネオジャパン	0.9		—		—
P R T I M E S	2.2		2.7		4,633
ラクス	36.2		39		103,935
ダブルスタンダード	3.4		3.7		5,564
オーブントア	5.7		6.3		4,554
アカツキ	4.2		4.4		10,172
Ubicomホールディングス	2.8		3.1		5,297
カナミックネットワーク	12.8		12.6		4,888
チェンジホールディングス	18.8		19.6		30,576
シンクロ・フード	6.4		—		—
オークネット	4.3		4.5		8,284
マクロミル	18		17		13,464
オロ	2.9		3.7		9,227
ユーザーローカル	3.2		3.2		5,510
マネーフォワード	17.2		18.5		84,027
S U N A S T E R I S K	—		6.2		6,181
プラスアルファ・コンサルティング	—		4.9		13,323

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
電算システムホールディングス	4	4.2	11,671	
APPIER GROUP	—	28.4	46,576	
プロトコーポレーション	10	10.5	14,070	
野村総合研究所	156.3	177.3	736,149	
サイバネットシステム	8.4	—	—	
日本システム技術	3.9	2.8	7,582	
インテジホールディングス	10.6	9.5	15,580	
ソースネクスト	41.1	—	—	
インフォコム	9.9	10.6	25,991	
シンプレクス・ホールディングス	12.9	13.5	35,370	
HEROZ	3.3	3	4,137	
ラクスル	11	20.1	28,743	
メルカリ	33.6	50.1	141,757	
I P S	2.7	3	6,048	
F I G	11.9	—	—	
システムサポート	3.9	3.4	6,409	
イーソル	3.1	7.5	4,560	
アルテリア・ネットワークス	8.3	—	—	
ウイングアーク1st	8.1	8.7	28,579	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	—	2.6	3,543	
サーバーワークス	1.8	1.9	6,754	
Sansan	29	27.3	42,205	
ギフトィ	8.5	7.6	14,432	
メドレー	—	11.1	49,117	
ベース	2.6	3.1	10,323	
JMDC	12.6	13.7	59,101	
フォーカスシステムズ	7	6.8	6,738	
クレスコ	6.3	7	13,370	
フジ・メディア・ホールディングス	73.6	79.5	121,158	
オービック	25.4	27.6	626,382	
ジャストシステム	11.2	11.9	39,627	
TDCソフト	6.7	7.2	15,112	
LINEヤフー	1,087.2	1,160	499,496	
トレンドマイクロ	44.1	39.1	293,797	
IDホールディングス	—	6.1	9,339	
日本オラクル	14.8	15.9	181,816	
アルファシステムズ	2.4	3	8,382	
フューチャー	18.9	18.5	33,374	
CAC Holdings	4.9	5.3	9,476	
SBテクノロジー	3.6	3.7	9,227	
オービックビジネスコンサルタント	15	12.3	83,135	
伊藤忠テクノソリューションズ	40.8	—	—	
アイティフォー	11.3	11.5	13,386	
東計電算	1.4	1.4	9,870	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
大塚商会	43.3	40.8	246,228	
サイボウズ	10.8	11.6	24,151	
電通国際情報サービス	9.1	10	49,200	
ACCESS	10.3	10.4	7,602	
デジタルガレージ	13.6	14.7	45,496	
イーエムシステムズ	13.5	14.5	10,309	
ウェザーニューズ	2.8	2.5	14,675	
C I J	7.8	14.7	9,084	
ビジネスエンジニアリング	2	1.5	6,630	
WOWOW	5.8	7	7,623	
スカラ	10	8.7	6,655	
インテリジェント ウェイブ	5.3	—	—	
ANYCOLOR	—	3	11,550	
IMAGICA GROUP	7	8	5,016	
ネットワンシステムズ	28.6	30.9	63,530	
アルゴグラフィックス	7	7.5	28,012	
マーベラス	13.6	14.2	9,897	
エイベックス	13.5	14.2	19,766	
B I P R O G Y	28.2	27	115,371	
兼松エレクトロニクス	4.8	—	—	
都築電気	4.6	4.5	9,418	
TBSホールディングス	39.1	42.3	116,176	
日本テレビホールディングス	67.6	72.9	105,048	
朝日放送グループホールディングス	2.6	9.6	6,172	
テレビ朝日ホールディングス	18.8	19.9	33,332	
スカパーJSATホールディングス	68.6	73.7	49,968	
テレビ東京ホールディングス	6	6	17,940	
日本BS放送	—	6.5	5,765	
ビジョン	10.5	12.6	14,641	
USEN-NEXT HOLDINGS	7	9.3	35,107	
コネクシオ	5.3	—	—	
日本通信	75.2	78.5	17,819	
日本電信電話	977.2	24,550	4,249,605	
KDDI	589.4	637	2,946,125	
ソフトバンク	1,225.3	1,326	2,384,811	
光通信	9	8.9	204,611	
エムティーアイ	9.1	8.2	4,936	
GMOインターネットグループ	28.5	30.6	72,720	
ファイバーゲート	5.3	5	4,805	
KADOKAWA	40.5	43.6	116,150	
学研ホールディングス	13.8	14.4	14,068	
ゼンリン	13.6	14.5	12,963	
アイネット	5.8	5.7	10,830	
松竹	4.5	4.7	44,076	
東宝	47.6	46	236,026	

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
東映	2.1	2.3	40,756	
NTTデータグループ	238.5	222.5	399,832	
ビー・シー・エー	5.3	5.2	6,099	
ビジネスブレイン太田昭和	4	3.9	8,338	
D T S	16.3	17.2	60,458	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	38.4	39.2	201,174	
シーイーシー	11.1	11.7	21,001	
カブコン	75.7	74.5	371,233	
アイ・エス・ビー	4.5	4.6	6,913	
ジャステック	5.6	5.5	8,046	
S C S K	61.9	58	157,992	
NSW	3.3	3.3	9,685	
アイネス	6	6.3	10,495	
T K C	13.2	12.7	44,958	
富士ソフト	8.5	17.2	103,028	
N S D	26.7	29	81,200	
コナミグループ	32.7	32.1	234,811	
福井コンピュータホールディングス	5.4	6.5	17,179	
J B C Cホールディングス	5.9	6.2	19,685	
ミロク情報サービス	7.6	7.9	13,722	
ソフトバンクグループ	441.1	406	2,444,120	
卸売業（7.0%）				
高千穂交易	3.3	2.7	9,180	
伊藤忠食品	1.8	2	14,320	
エレマテック	7.4	8	14,136	
あらた	6.2	6.6	41,250	
トーマンデバイス	1.3	1.4	7,420	
東京エレクトロン デバイス	3	9.6	46,800	
円谷フィーズホールディングス	7.2	15.1	17,002	
双日	85.3	96.4	317,445	
アルフレッサ ホールディングス	81.1	87.6	208,269	
横浜冷凍	24.1	24.3	26,948	
ラサ商事	5.8	5	7,545	
アルコニックス	11.4	12	15,840	
神戸物産	62.2	67.5	263,520	
あい ホールディングス	12.8	13.8	34,113	
ダイワボウホールディングス	32.9	36.8	107,069	
マクニカホールディングス	19.5	20.6	150,647	
ラクト・ジャパン	3.6	3.8	7,413	
グリムス	3.5	3.8	8,002	
バイタルケーエスター・ホールディングス	13.4	13.4	14,351	
八洲電機	7.8	7.7	9,786	
メディアスホールディングス	6.8	7	5,404	
レスターホールディングス	7.6	8	21,464	
ジオリーブグループ	4.7	3	3,735	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
大光	—	8.9	5,678	
T O K A Iホールディングス	39.5	42.3	39,804	
三洋貿易	8.9	10.1	13,261	
ビューティガレージ	1.8	3	7,560	
ウイン・パートナーズ	5.6	6.8	8,105	
シップヘルスケアホールディングス	29.1	31.5	65,756	
コメダホールディングス	20.3	21.6	59,767	
フルサト・マルカホールディングス	8	8.3	22,410	
ヤマエグループホールディングス	5	5	17,325	
小野建	8.2	8.7	14,676	
南陽	—	2.5	5,145	
佐島電機	6.1	4.6	9,034	
伯東	4.7	5	27,350	
コンドーテック	7.3	7.6	8,884	
ナガイレーベン	10.5	11	24,992	
三菱食品	8.3	8.3	40,338	
松田産業	6.2	6.8	17,387	
第一興商	15.7	33.8	75,543	
メディバルホールディングス	83.6	88.1	206,154	
S P K	4.8	4.4	8,047	
萩原電気ホールディングス	3.7	4.5	22,230	
アズワン	11.8	12.4	62,892	
スズデン	3.8	3.8	8,675	
尾家産業	4.7	2.5	4,725	
シモジマ	6.2	6.7	8,455	
ドウシシャ	8.5	9	18,990	
高速	4.4	6	12,234	
たけびし	—	3.7	6,985	
リックス	2	2	6,560	
丸文	8.6	8.3	12,516	
ハビネット	7.2	7.9	20,358	
日本ライフライン	24.3	25.7	29,914	
タカショー	9.1	9.6	5,280	
I D O M	25.1	26.8	24,709	
進和	5.8	5.8	14,494	
ダイトロン	3.6	3.6	10,670	
シークス	11.7	12.3	18,671	
オーハシテクニカ	4.9	4.7	8,215	
白銅	3.2	3.4	7,816	
伊藤忠商事	495.4	584	3,350,992	
丸紅	633	721.9	1,665,423	
高島	1	—	—	
長瀬産業	37.2	39.5	91,778	
蝶理	4.4	6	16,710	
豊田通商	70	76.3	624,897	

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
三共生興	17.3		14.6	10,833
兼松	30.7		33.7	69,219
三井物産	588.6		654.4	3,528,524
日本紙パルプ商事	4.3		4.6	22,977
カメイ	8.9		9.5	16,197
OUGホールディングス	—		1	2,390
スターゼン	6.4		6.6	16,255
山善	21.4		22.4	26,880
椿本興業	1.5		2.5	15,100
住友商事	497.6		527.7	1,635,870
内田洋行	3.7		3.5	25,200
三菱商事	502.5		574	3,952,564
第一実業	3.1		9.3	17,818
キャンマーケティングジャパン	18.6		20.2	75,366
西華産業	4.1		4	10,708
佐藤商事	6.1		6.3	9,601
菱洋エレクトロ	7.4		7.5	27,825
東京産業	8.4		8.9	7,734
ユアサ商事	7.1		7.5	33,225
神鋼商事	2.2		2.3	13,133
阪和興業	14.3		15.5	70,680
正栄食品工業	5.5		5.8	26,187
カナデン	7.3		6.7	9,869
RYODEN	6.7		7.1	18,502
岩谷産業	18.4		19.9	141,409
ナイス	3.4		2.6	4,209
極東貿易	6		5.9	11,139
アステナホールディングス	17.8		18.3	9,095
三愛オブリ	22.3		22.9	37,029
稲畑産業	16.3		16.9	53,488
GSIクレオス	5.6		5.4	11,080
明和産業	11.6		12.5	8,237
ワキタ	15.5		16.1	23,908
東邦ホールディングス	20.8		22.8	73,644
サンゲツ	20.5		22	63,096
ミツウロコグループホールディングス	11.8		11.9	15,612
シナネンホールディングス	2.7		3	12,195
伊藤忠エネクス	19.3		21.1	32,240
サンリオ	23		24.8	150,511
サンワテクノス	4.8		4.6	10,271
リョーサン	8.8		9.3	45,988
新光商事	12.1		12.3	14,858
トーヨー	4.2		4	12,380
三信電気	3.7		3.9	8,954
東陽テクニカ	9.5		9.2	12,769

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	数	株数	評価額
モスフードサービス	12		12.6	42,021
加賀電子	6.6		7	46,410
ソーダニッカ	—		8	8,272
立花エレテック	6		6.4	18,592
PAL TAC	12.7		13.8	65,619
三谷産業	19.1		18.6	6,212
太平洋興発	9.5		6.4	5,088
西本Wismettacホールディングス	2.2		2.3	14,237
コーア商事ホールディングス	6.6		—	—
KPPグループホールディングス	19.3		25	17,725
ヤマタネ	5		4.5	10,116
日鉄物産	5.2		—	—
泉州電業	3.8		4.8	16,296
トラスコ中山	16.8		18.2	43,261
オートボックスセブン	29		30.1	46,519
モリト	7.8		7.3	9,453
加藤産業	9.5		10.6	49,608
イエローハット	14.1		15	26,670
JKホールディングス	6.8		7.2	6,962
日伝	5		6.5	17,231
杉本商事	3.8		5	11,230
因幡電機産業	20.2		21.9	71,832
東テク	2.8		3	14,235
ミスミグループ本社	121.3		131.5	315,600
タキヒヨー	6.6		2.9	2,952
スズケン	25		32.5	163,897
ジェコス	2		6.1	6,466
小売業（4.3%）				
ローソン	20.2		19.1	139,831
サンエー	6		6.6	30,360
カワチ薬品	6.6		7	17,857
エービーシー・マート	11.7		37.8	92,250
ハードオフコーポレーション	4.2		3.8	5,814
アスクル	19.7		18.2	39,293
ゲオホールディングス	8.8		9	21,123
アダストリア	10		10.6	40,280
くら寿司	9.6		10.3	37,852
キャンドゥ	4.5		4.2	10,999
バルグループホールディングス	8.2		17	39,712
エディオン	31.5		34.7	51,529
サーラコーポレーション	17.9		18.9	13,437
ハローズ	3.7		4	16,580
フジオフードグループ本社	7.5		10.6	15,306
あみやき亭	—		2.4	8,784
ひらまつ	26.4		—	—

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
大黒天物産	3	2.7	16,632	
ハニーズホールディングス	7.8	7.2	12,038	
アルベン	6.8	7.3	14,235	
クオールホールディングス	11.7	12.2	20,813	
ジンズホールディングス	5	5.3	24,883	
ビックカメラ	53.5	46.2	56,410	
DCMホールディングス	49.3	50	63,950	
MonotaRO	113.9	123.7	184,684	
DDグループ	—	1.5	1,999	
アークランドサービスホールディングス	6.9	—	—	
J. フロント リテイリング	100.6	104.2	141,138	
ドトール・日レスホールディングス	14.3	15.4	33,803	
マツキヨココカラ&カンパニー	48.8	158.7	405,240	
ブロンコビルー	5	5.2	16,432	
ZOZO	53.3	57.7	180,312	
トレジャー・ファクトリー	2.6	4.2	5,304	
物語コーポレーション	4.5	14.6	56,648	
三越伊勢丹ホールディングス	135.7	147	245,637	
Hamee	4.3	—	—	
ウエルシアホールディングス	41.8	45.4	117,313	
クリエイトSDホールディングス	13	14.1	43,146	
チムニー	7.5	3.5	4,854	
シュッピン	6.5	7.2	8,913	
オイシックス・ラ・大地	11	11.8	16,437	
ネクステージ	18.4	20	45,780	
ジョイフル本田	25.6	25	44,800	
鳥貴族ホールディングス	3.7	3.7	10,500	
ホットランド	7.4	7.1	14,001	
すかいらーくホールディングス	110.6	119.2	259,915	
SFPホールディングス	5	4.6	10,271	
綿半ホールディングス	6.8	7.1	9,727	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	27.8	29.3	29,622	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.2	—	—	
BEE NOS	4.7	3.8	5,681	
あさひ	6.8	7.6	10,009	
日本調剤	6.1	6.4	8,243	
コスモス薬品	9.1	8.7	136,155	
セブン&アイ・ホールディングス	277.3	300.4	1,650,698	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	61.1	59.7	62,386	
ツルハホールディングス	19.8	18.3	227,652	
サンマルクホールディングス	7.3	7.3	14,585	
フェリシモ	5	4	3,652	
トリドールホールディングス	20.1	21.6	89,661	
TOKYO BASE	—	10.4	2,818	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
JMホールディングス	7.2	6.9	14,331	
アレンザホールディングス	6.6	7.3	7,402	
串カツ田中ホールディングス	3.6	3.8	6,175	
パロックジャパンリミテッド	1.4	—	—	
クスリのアオキホールディングス	8.1	23.4	80,074	
力の源ホールディングス	6.2	3.8	5,958	
FOOD & LIFE COMPANIES	46.4	46.6	133,415	
メディカルシステムネットワーク	5.3	—	—	
ノジマ	26.2	28.3	39,506	
カッパ・クリエイト	13.5	13.7	22,659	
ライトオン	9.2	—	—	
良品計画	104.1	95.4	222,902	
アドヴァングループ	11	10.5	10,909	
アルビス	3.1	3.1	8,001	
G-7ホールディングス	9.9	9.6	11,548	
イオン北海道	13.2	15.2	13,558	
コジマ	16.2	15.6	11,278	
コーナン商事	10.9	11.8	43,660	
エコス	3.7	3.7	8,239	
ワタミ	11	10.3	10,712	
バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	180.4	176.2	564,544	
西松屋チェーン	18.1	17.5	37,747	
ゼンショーホールディングス	43.9	43.2	354,844	
幸楽苑ホールディングス	6.8	—	—	
サイゼリヤ	13.7	13	74,620	
V Tホールディングス	31.1	34.5	18,078	
フジ・コーポレーション	5.1	3.8	6,080	
ユナイテッドアローズ	9	9.4	18,414	
ハイデイ日高	12.1	13.1	36,011	
コロナイド	37.7	39.7	88,689	
壱番屋	6.3	6.8	36,244	
スギホールディングス	16.3	17.6	112,886	
薬王堂ホールディングス	4.6	4.6	12,470	
スクロール	12.8	13.2	12,210	
ヨンドシーホールディングス	7.6	7.7	15,053	
木曾路	12.9	12.8	31,884	
S R Sホールディングス	16	15.7	16,280	
千趣会	17.1	—	—	
リテールパートナーズ	12	12.9	22,936	
ケーヨー	13.9	—	—	
上新電機	7.1	7.6	17,578	
日本瓦斯	43.3	46.5	104,020	
ロイヤルホールディングス	15.8	16.5	44,154	
いなげや	8.1	8.6	12,908	

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
チヨダ	10.2	9.5	8,008	
ライフコーポレーション	7.1	7.7	26,218	
リンガーハット	11.3	11.1	25,663	
MrMaxHD	12.2	13.2	8,289	
AOKIホールディングス	15.9	16.9	19,992	
オークワ	13.5	14.7	12,201	
コメリ	12.3	13.4	42,277	
青山商事	18.2	18.9	29,880	
しまむら	9.4	10.2	168,861	
高島屋	61.3	64.1	127,719	
松屋	14.4	15.3	13,142	
エイチ・ツー・オー リテイリング	39.5	41.6	68,473	
近鉄百貨店	4	4.8	12,686	
丸井グループ	59.3	60.4	142,815	
アクシアル リテイリング	5.4	5.9	22,980	
イオン	272.8	295.7	905,137	
イズミ	12.4	13.2	46,648	
平和堂	13.2	14.8	34,365	
フジ	12.5	13.2	24,750	
ヤオコー	9.1	9.8	79,056	
ゼビオホールディングス	11.3	12.2	11,516	
ケーズホールディングス	64.3	61.5	77,459	
Olympicグループ	8	5.2	2,657	
シルバーライフ	2.5	2.5	2,585	
Genky DrugStores	4.1	3.7	18,870	
ブックオフグループホールディングス	5.2	5.3	5,750	
ギフトホールディングス	1.9	3.9	7,924	
アインホールディングス	11.2	12.1	54,450	
元気寿司	3.3	6	19,140	
ヤマダホールディングス	331	289.7	124,136	
アークランズ	12.3	27.1	44,660	
ニトリホールディングス	32.6	31.7	540,802	
グルメ杵屋	8.7	8.3	8,798	
ケユーホールディングス	3.3	5.9	6,643	
吉野家ホールディングス	32	34	111,180	
松屋フーズホールディングス	3.8	4.1	20,500	
サガミホールディングス	14.2	13.8	19,044	
関西フードマーケット	8.1	7.7	10,895	
王将フードサービス	5.1	5.8	46,458	
ミニストップ	7	6.7	10,130	
アークス	14.2	16.1	43,759	
パローホールディングス	15.1	16.9	40,069	
ベルク	3.9	4.3	27,391	
大庄	7.8	5	6,305	
ファーストリテイリング	12.1	39.2	1,469,608	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
サンドラッグ	30.6	30.5	136,487	
サックスパー ホールディングス	9.4	7.7	6,891	
やまや	3.5	2	6,080	
ベルーナ	19.7	21.2	13,271	
銀行業 (7.2%)				
いよぎんホールディングス	88.1	97.1	92,808	
しずおかフィナンシャルグループ	168	180.8	216,236	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	62.3	68.3	72,329	
楽天銀行	—	27.7	70,856	
京都フィナンシャルグループ	—	25.7	227,419	
島根銀行	—	4	2,056	
じもとホールディングス	—	7	3,899	
めぶきフィナンシャルグループ	372	403.7	179,646	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9.7	10.5	45,150	
九州フィナンシャルグループ	126.7	142.3	118,507	
ゆうちょ銀行	212.4	875	1,277,062	
富山第一銀行	21.1	25	19,675	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	410.5	436.2	302,679	
西日本フィナンシャルホールディングス	47.6	50.6	82,629	
三十三フィナンシャルグループ	7.4	7.5	14,010	
第四北越フィナンシャルグループ	11.1	12.6	49,644	
ひろぎんホールディングス	97.8	105.7	97,983	
おきなわフィナンシャルグループ	7.6	6.9	16,546	
十六フィナンシャルグループ	10	10.5	40,215	
北國フィナンシャルホールディングス	6.4	8.5	38,505	
プロクレアホールディングス	9.7	10.1	19,159	
あいちフィナンシャルグループ	10.4	11.4	26,733	
SBI新生銀行	22.7	—	—	
あおぞら銀行	46.7	50.9	154,736	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,906.5	5,084.9	6,381,549	
りそなホールディングス	953.5	970.6	745,906	
三井住友トラスト・ホールディングス	138.1	145.8	810,502	
三井住友フィナンシャルグループ	546.5	577	4,187,866	
千葉銀行	207.6	226.4	250,511	
群馬銀行	144.5	157.7	117,928	
武蔵野銀行	9.9	10.2	29,131	
千葉興業銀行	22	13	10,790	
筑波銀行	41.1	32	8,544	
七十七銀行	24.1	26	89,180	
秋田銀行	5.9	4.8	9,489	
山形銀行	10	9	9,531	
岩手銀行	6	5.8	14,355	
東邦銀行	67.9	60	17,460	
東北銀行	—	3	3,489	
ふくおかフィナンシャルグループ	59.6	64.8	222,458	

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	
スルガ銀行	67.7	72.6	54,522
八十二銀行	150.8	170.8	136,827
山梨中央銀行	9.4	7.9	14,172
大垣共立銀行	14.5	15.4	29,213
福井銀行	8.1	7.5	11,655
清水銀行	1.5	3.6	5,515
富山銀行	3.4	1.5	2,560
滋賀銀行	12.4	13.6	50,932
南都銀行	11.5	12.3	30,577
百五銀行	72.4	76	41,116
京都銀行	23.5	—	—
紀陽銀行	26.4	28.9	45,979
ほくほくフィナンシャルグループ	48.6	51.4	80,595
山陰合同銀行	47	50.5	48,379
鳥取銀行	—	2.5	3,312
百十四銀行	8.1	7.6	19,737
四国銀行	14.4	13.3	13,313
阿波銀行	11.1	11.5	28,692
大分銀行	5.8	5.1	13,474
宮崎銀行	5.8	5.2	13,759
佐賀銀行	5.4	5.1	9,562
琉球銀行	21	19.2	21,484
セブン銀行	268.2	292.9	87,957
みずほフィナンシャルグループ	1,081.3	1,105.3	2,776,513
高知銀行	—	2.5	2,410
山口フィナンシャルグループ	83.2	79	102,581
長野銀行	3.3	—	—
名古屋銀行	5.1	5.3	29,468
北洋銀行	117.9	123	44,895
大光銀行	—	2.5	3,270
愛媛銀行	12	11.6	11,692
トマト銀行	—	2.5	2,862
京葉銀行	38.4	37.4	26,217
栃木銀行	38.2	39.2	12,465
北日本銀行	—	2.6	5,501
東和銀行	16.6	15.2	9,454
大東銀行	—	3	2,298
トモニホールディングス	64.9	65.7	32,193
フィデアホールディングス	9.5	8.5	12,478
池田泉州ホールディングス	106.3	100	34,200
証券・商品先物取引業（0.8%）			
FPG	31.2	27.6	44,932
ジャパンインベストメントアドバイザー	6.7	6.8	10,737
マーキュリアホールディングス	—	5.7	4,599
SBIホールディングス	107.9	117.4	376,501

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
ジャフコグループ	25.4	27.5	46,832
大和証券グループ本社	529.9	597.2	570,564
野村ホールディングス	1,374.4	1,395.5	847,487
岡三証券グループ	66.1	72.6	51,836
丸三証券	29.9	28	23,772
東洋証券	29.1	29.4	8,790
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	81.2	87	48,111
水戸証券	23.7	23.8	10,376
いちよし証券	17	14.8	10,833
松井証券	44.7	47.9	35,541
マネックスグループ	84.3	83.5	55,193
極東証券	12.9	10.9	11,259
岩井コスモホールディングス	10	9.4	16,544
アイザワ証券グループ	11.9	12.2	14,615
スパークス・グループ	8.7	9.2	13,698
保険業（2.4%）			
かんぽ生命保険	91.2	90.2	249,403
F P パートナー	—	1.3	6,500
S O M P Oホールディングス	128.3	132.3	893,951
アニコムホールディングス	29	28.5	17,185
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	168.4	176.7	977,681
第一生命ホールディングス	381.2	396.7	1,222,232
東京海上ホールディングス	753.5	802.4	2,927,155
T & Dホールディングス	201.2	226.7	495,679
アドバンスクリエイト	7.4	6.3	6,312
その他金融業（1.2%）			
全国保証	19.7	21.4	106,935
あんしん保証	—	1.7	425
ジェイリース	2.8	2.4	4,480
日本モーゲージサービス	7.6	7.5	3,952
アルヒ	16.2	11	9,207
プレミアグループ	12.9	13.9	24,589
ネットプロテクションズホールディングス	26	17.2	4,179
クレディセゾン	47.8	51.4	128,011
芙蓉総合リース	6.8	7.4	88,800
みずほリース	10.9	11.9	59,024
東京センチュリー	13.8	15.1	88,969
日本証券金融	31.4	30.1	46,925
アイフル	126.3	135.4	51,316
リコーリース	7.3	7.6	35,264
イオンフィナンシャルサービス	42.6	46.5	58,915
アコム	140.9	148.5	51,752
ジャックス	8	8.6	46,182
オリエントコーポレーション	19.8	21.3	23,046

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	
オリックス	499.8	501.5	1,353,297
三菱HCキャピタル	287.4	334	322,109
九州リースサービス	—	5.6	5,264
日本取引所グループ	210.6	214.8	648,481
イー・ギャランティ	12.5	13.7	26,605
アサクス	—	5.4	3,769
NECキャピタルソリューション	4	3.9	13,123
不動産業（2.0%）			
Robot Home	0.8	25.8	4,644
大東建託	27.5	29.7	484,110
いちご	89	100.7	35,345
日本駐車場開発	95.8	94.3	19,237
スター・マイカ・ホールディングス	9	11	6,677
SREホールディングス	3.9	4.2	11,650
ヒューリック	175	188.5	276,718
三栄建築設計	4.7	—	—
野村不動産ホールディングス	46.8	50.5	182,002
三重交通グループホールディングス	18.9	19.1	10,925
サムティ	10.1	10.1	23,654
ディア・ライフ	13.5	15	13,140
地主	7.3	7.1	16,372
プレサンスコーポレーション	11.4	13.9	20,905
JPMC	5.8	5.6	6,288
フージャースホールディングス	13.7	13.4	14,177
オープンハウスグループ	27.4	29.7	122,601
東急不動産ホールディングス	225.5	243.3	222,376
飯田グループホールディングス	65.6	77	170,170
And Doホールディングス	5.8	—	—
シーアールイー	4.2	5.3	8,352
ケイアイスター不動産	4.4	4.2	14,658
グッドコムアセット	8.4	8.9	8,980
ジェイ・エス・ビー	2.1	4.4	11,268
ロードスターキャピタル	3.7	5.9	12,980
パーク24	58.8	53.5	96,433
バラカ	4.4	3.9	7,542
宮越ホールディングス	0.8	4.6	5,731
三井不動産	325.8	368	1,277,696
三菱地所	475.7	517.9	1,033,987
平和不動産	13	13.9	56,086
東京建物	71.6	72.7	152,779
京阪神ビルディング	11	15.7	22,262
住友不動産	135.8	123.7	516,323
テーオーシー	16.8	17.7	10,620
東京楽天地	1.9	1.8	7,740
レオパレス21	—	92.5	43,660

銘柄	期首(前期末)		期末 評価額
	株数	株数	
スターツコーポレーション	11.4	12.6	35,141
フジ住宅	13.7	12.7	9,080
空港施設	12.6	12	6,780
明和地所	9.3	—	—
ゴールドクレスト	8.1	8.2	16,457
エスリード	4.5	4.2	13,356
日神グループホールディングス	17.1	15.2	7,524
日本エスコン	19.5	19.6	17,934
MIRARTHホールディングス	43	47.2	21,995
イオンモール	39.5	41.9	72,047
毎日コムネット	—	6.3	4,680
カチタス	20.6	22.4	48,160
トーセイ	13.5	14.6	26,294
穴吹興産	—	2.9	5,863
サンフロンティア不動産	13.5	15.5	24,180
FJネクストホールディングス	9.2	9.6	11,001
グランディハウス	4.1	—	—
日本空港ビルデング	26.7	28.8	187,200
サービス業（4.8%）			
日本工営	5.8	—	—
LIFULL	34.3	32.4	6,350
MIXI	18	19.1	46,164
ジェイエイシーリクルートメント	7.1	7.5	19,957
日本M&Aセンターホールディングス	134.6	136.3	93,392
メンバーズ	2.6	3.1	3,410
UTグループ	11.6	12.3	27,244
アイティメディア	3.3	3.5	3,402
E・Jホールディングス	5.7	5.4	8,667
オープンアップグループ	28.6	25.2	54,406
コシダカホールディングス	23.8	25.6	26,700
アルトナー	—	2	3,614
パソナグループ	9.5	10.2	23,919
リンクアンドモチベーション	23.2	26.1	15,294
エス・エム・エス	30	30.7	86,267
パーソルホールディングス	87.8	884.4	225,345
リニカル	6.4	6.3	3,339
クックパッド	36	—	—
学情	4.1	4.5	9,094
スタジオアリス	4.7	4.8	9,907
シミックホールディングス	5.1	—	—
NJS	—	1.5	4,240
総合警備保障	29.3	150.3	128,777
カカコム	58.7	57.6	96,624
アイロムグループ	3.1	3.5	7,108
セントケア・ホールディング	5.8	5.6	5,241

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ルネサンス	7.1	6.6	5,709	
ディップ	13.8	13.5	42,795	
デジタルホールディングス	6.8	5.5	6,957	
新日本科学	8.5	7.7	12,681	
キャリアデザインセンター	—	1.4	2,821	
ベネフィット・ワン	36.6	31	46,965	
エムスリー	154.6	169	413,289	
アウトソーシング	47.2	54.4	65,280	
ウェルネット	9.6	5.5	3,107	
ワールドホールディングス	4	3.9	10,572	
ディー・エヌ・エー	33.8	33.8	50,835	
博報堂DYホールディングス	100.5	107.8	120,250	
ぐるなび	15	—	—	
タカミヤ	14	14	6,384	
ジャパンベストレスクエストム	5.9	—	—	
ファンコミュニケーションズ	18.4	15	6,255	
ライク	3.4	3.8	5,183	
エスプール	22.8	25.6	10,163	
WDBホールディングス	4.2	4.5	10,408	
アドウェイズ	11.5	12.2	6,722	
バリューコマース	6.3	7.9	10,949	
インフォマート	82.9	88.1	38,852	
J Pホールディングス	27.4	27.1	10,596	
プレステージ・インターナショナル	33.8	42	27,342	
アミューズ	4.9	5	7,545	
ドリームインキュベータ	2.8	2.8	9,044	
クイック	6.5	5.8	13,090	
電通グループ	82.2	83.2	331,552	
びあ	2.9	3.1	10,276	
イオンファンタジー	3.7	3.5	9,107	
シーティーエス	10.2	10.6	7,070	
H. U. グループホールディングス	23.4	24.8	63,711	
アルプス技研	7.1	7.8	21,262	
日本空調サービス	10.3	10.2	8,170	
オリエンタルランド	82.8	449	2,256,225	
ダスキン	17.7	21	68,418	
明光ネットワークジャパン	14.3	13.8	9,894	
ファルコホールディングス	4.5	4.3	9,103	
ラウンドワン	66.3	78	46,020	
リゾートトラスト	31.3	39	87,769	
ビー・エム・エル	9.7	10.2	29,916	
りらいあコミュニケーションズ	13	—	—	
リソー教育	39.9	41.9	10,097	
早稲田アカデミー	5.6	5.5	8,712	
ユー・エス・エス	80.7	97	280,621	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
東京個別指導学院	12.1	12.4	5,952	
サイバーエージェント	187.7	187.5	167,737	
楽天グループ	345.7	725.6	424,983	
クリーク・アンド・リバー社	4.9	5.1	10,674	
SBIグローバルアセットマネジメント	15.2	15.8	8,800	
テー・オー・ダブリュー	22	19.3	6,253	
山田コンサルティンググループ	4.9	3.1	5,735	
セントラルスポーツ	3.6	3.7	9,079	
フルキャストホールディングス	7.5	8	15,336	
エン・ジャパン	14.3	15.2	39,337	
テクノプロ・ホールディングス	52.7	50.1	172,043	
アイ・アールジャパンホールディングス	4.4	4.7	7,355	
Keeper 技研	5.7	5	29,400	
Gunosy	6.2	8.1	5,637	
イー・ガーディアン	3.3	3.7	5,694	
ジャパンマテリアル	24	26	67,522	
ベクトル	13	11.7	12,788	
チャーム・ケア・コーポレーション	7.3	7.4	8,872	
キャリアリンク	3.3	3.2	7,001	
IBJ	5.6	7.1	5,246	
アサンテ	5.2	5.2	8,403	
バリューHR	7.5	8	11,984	
M&Aキャピタルパートナーズ	7.4	6.9	15,642	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4.2	4.2	4,271	
ERIホールディングス	3.8	1.9	3,273	
アビスト	—	0.5	1,520	
シグマックス・ホールディングス	12.3	11.3	14,983	
ウィルグループ	7	7	7,833	
メドピア	6.5	7.7	5,913	
リクルートホールディングス	578.7	628	3,457,140	
エラン	10.5	11.5	11,718	
日本郵政	1,025.7	999.8	1,304,239	
ベルシステム24ホールディングス	10.9	11.6	19,302	
鎌倉新書	9.7	7.4	4,314	
エアトリ	5.4	6.5	10,211	
アトラエ	6.6	5.9	4,230	
ストライク	3.9	3.8	14,744	
ソラスト	22.1	23.7	13,911	
セラク	3.3	2.9	3,883	
インソース	9.8	18.5	17,667	
ベイカレント・コンサルティング	58	62.2	309,507	
Orchestra Holdings	2	—	—	
アイモバイル	5	14.1	6,471	
ジャパンエレベーターサービズホールディングス	27.7	27.3	64,155	

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	
グリーンズ	—	—	2.4	—	4,658
ウェルビー	6.9	—	5.4	—	4,023
エル・ティール・エス	1.3	—	1.3	—	5,050
ミダックホールディングス	4.8	—	5.3	—	9,285
キュービーネットホールディングス	5.2	—	4.7	—	7,148
RPAホールディングス	13.6	—	13.4	—	4,046
マネジメントソリューションズ	4.6	—	3.8	—	11,092
フロンティア・マネジメント	3.4	—	2.3	—	3,599
アンビスホールディングス	—	—	8.6	—	24,725
カーブスホールディングス	24.4	—	23.2	—	15,474
フォーラムエンジニアリング	0.7	—	10.2	—	8,109
FAST FITNESS JAPAN	3.2	—	3.4	—	3,791
ダイレクトマーケティングミックス	9.3	—	10.9	—	5,024
LITALICO	6.2	—	6.7	—	14,344
リログループ	44	—	45.7	—	70,972
東祥	7	—	6.9	—	5,630
ID&E ホールディングス	—	—	5.1	—	16,702
ビーウィズ	3.3	—	2.4	—	5,450
TREホールディングス	16.7	—	17.9	—	20,083
人・夢・技術グループ	3.8	—	3.6	—	6,674
NISSOホールディングス	—	—	6.8	—	5,344
大栄環境	—	—	15.5	—	35,975
日本管財ホールディングス	—	—	8.4	—	20,899
M&A総研ホールディングス	—	—	4	—	15,200
エイチ・アイ・エス	20.8	—	24.7	—	42,533
ラックランド	3.3	—	4.1	—	11,213
共立メンテナンス	13.4	—	14.3	—	82,067
イチネンホールディングス	8.9	—	9.1	—	14,041
建設技術研究所	4.2	—	4.4	—	21,362
スペース	7.2	—	7.1	—	6,439
燦ホールディングス	4.1	—	7.6	—	8,390
スバル興業	—	—	0.5	—	6,615
東京テアトル	9	—	5	—	5,460
タナベコンサルティンググループ	—	—	1.5	—	1,560
ナガワ	2	—	2.9	—	19,401

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株	数	株	数	
東京都競馬	6.8	—	7.2	—	31,752
カナモト	14.6	—	14.4	—	37,152
ニシオホールディングス	7.3	—	7.6	—	27,664
トランス・コスモス	9.7	—	10.4	—	32,240
乃村工藝社	34.3	—	36.6	—	30,744
藤田観光	4.1	—	3.8	—	15,086
KNT-CTホールディングス	5.7	—	2	—	2,490
日本管財	7.9	—	—	—	—
トーカイ	7.2	—	7.5	—	14,362
セコム	79.6	—	86.2	—	887,429
セントラル警備保障	4.6	—	4.7	—	11,533
丹青社	16.1	—	17	—	15,130
メイテックグルーブホールディングス	31.6	—	32.5	—	93,193
応用地質	7.7	—	7.8	—	16,309
船井総研ホールディングス	16.5	—	17.6	—	44,369
いであ	—	—	2.5	—	4,390
学究社	4.9	—	4.2	—	8,122
ベネッセホールディングス	29.9	—	—	—	—
イオンディライト	8.6	—	9.2	—	32,338
ダイセキ	16	—	17.3	—	67,816
ステップ	3.6	—	3.2	—	6,000
合計	株数・金額	88,126.6	千株	123,739.3	千円
	銘柄数<比率>	1,724銘柄	1,733銘柄	<98.3%>	

※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。

(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		百万円	
TOPIX	4,633		—	

■ 投資信託財産の構成

(2023年11月30日現在)

項目	期		末	
	評価額	比率	評価額	比率
株式	千円	%	千円	%
株	277,901,462	97.8	277,901,462	97.8
コール・ローン等、その他	6,396,437	2.2	6,396,437	2.2
投資信託財産総額	284,297,900	100.0	284,297,900	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2023年11月30日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	284,187,277,609円
コール・ローン等	3,532,670,222
株 式(評価額)	277,901,462,330
未 収 入 金	596,010,400
未 収 配 当 金	2,036,482,133
差 入 委 託 証 拠 金	120,652,524
(B) 負 債	1,548,319,526
未 払 金	395,461,400
未 払 解 約 金	1,152,851,240
そ の 他 未 払 費 用	6,886
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	282,638,958,083
元 本	67,612,101,406
次 期 繰 越 損 益 金	215,026,856,677
(D) 受 益 権 総 口 数	67,612,101,406口
1万口当たり基準価額(C/D)	41,803円

※当期における期首元本額65,393,298,021円、期中追加設定元本額11,963,349,687円、期中一部解約元本額9,744,546,302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2022年12月1日 至2023年11月30日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	6,233,393,018円
受 取 配 当 金	6,231,921,169
受 取 利 息	43,402
そ の 他 収 益 金	3,192,750
支 払 利 息	△ 1,764,303
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	44,665,331,709
売 買 益	51,596,604,918
売 買 損	△ 6,931,273,209
(C) 先 物 取 引 等 損 益	1,029,023,200
取 引 益	1,399,913,500
取 引 損	△ 370,890,300
(D) そ の 他 費 用 等	△ 136,879
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	51,927,611,048
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	157,426,042,586
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 26,859,790,389
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	32,532,993,432
(I) 合 計(E+F+G+H)	215,026,856,677
次 期 繰 越 損 益 金(I)	215,026,856,677

※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	9,698,799,980円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	20,073,130円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	1,001,422,329円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）	8,796,845円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,466,421,362円	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,397,731,905円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,671,641,660円	バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	7,994,782円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	136,038,750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＞	47,143,831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）	3,406,393円	SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	965,486,618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）	15,296,763円	SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	1,166,398,533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）	54,752,270円	SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	4,510,477,578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）	159,640,709円	SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	29,416,152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）	149,414,525円	SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	108,603,049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）	271,748,343円	SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	590,105,352円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,365,075,520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＞	35,412,893円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	26,260,180,571円	SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	195,641,630円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	115,624,640円	SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	641,083,284円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	168,156,238円	SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	414,428,470円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	103,225,362円	SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	1,267,607,584円
イオン・バランス戦略ファンド	37,149,436円	SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	314,855円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	50,643,471円	SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	27,021,199円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	208,010,508円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	29,338,861円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	197,543,121円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	25,915,474円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	777,703,738円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	14,447,235円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	448,368,315円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	67,115,115円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	525,557,954円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	173,003,538円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	55,602,276円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	37,568,256円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	1,154,657,014円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	32,445,682円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	39,519,295円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	6,832,341円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	236,791,813円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	30,702,488円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	240,914,837円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	411,103,933円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,981,135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）	156,608,259円
日興FWS・日本株インデックス	1,902,897,918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＞	157,255,373円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	68,065,303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＞	65,272,266円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	691,428円	SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	50,839,821円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	482,039円	SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	29,597,543円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	427,244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＞	50,954,848円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	135,914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＞	28,238,310円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	230,889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＞	45,469,182円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	554,713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＞	85,247,790円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	7,852,953円	SMDAM・日米3資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	15,940,785円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）	34,809,759円	三井住友・ニュー・アジア・ファンド（リスク3%）＜適格機関投資家限定＞	29,029,528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21期（2022年12月1日から2023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。 ・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	騰落率	(配当込み、 円換算ベース)	騰落率				
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
20期（2022年11月30日）	61,258	5.0	641.79	5.3	93.1	4.7	2.3	442,201
21期（2023年11月30日）	74,937	22.3	786.53	22.6	95.9	2.0	2.0	607,380

※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 (配当込み、 円換算ベース)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2022年11月30日	円 61,258	% -	641.79	% -	% 93.1	% 4.7	% 2.3
12月末	57,507	△ 6.1	602.34	△ 6.1	95.4	2.3	2.3
2023年 1月末	59,679	△ 2.6	625.57	△ 2.5	93.7	4.0	2.4
2月末	61,781	0.9	647.08	0.8	95.5	2.3	2.3
3月末	61,473	0.4	644.11	0.4	95.7	2.1	2.2
4月末	63,159	3.1	661.64	3.1	95.5	2.5	2.2
5月末	66,108	7.9	693.28	8.0	95.8	2.0	2.1
6月末	71,314	16.4	748.33	16.6	95.3	2.6	2.1
7月末	72,403	18.2	759.87	18.4	96.7	1.3	2.1
8月末	73,668	20.3	773.08	20.5	95.6	2.4	2.0
9月末	71,897	17.4	754.47	17.6	96.3	1.8	2.0
10月末	69,481	13.4	729.35	13.6	96.1	1.9	2.0
(期 末) 2023年11月30日	74,937	22.3	786.53	22.6	95.9	2.0	2.0

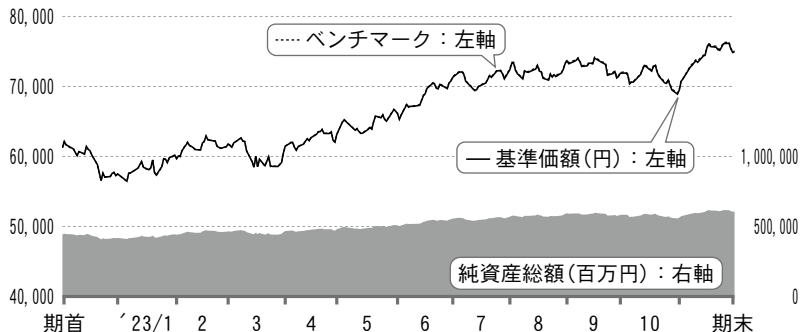
※騰落率は期首比です。

※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（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	61,258円
期末	74,937円
騰落率	+22.3%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）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（2022年12月1日から2023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、対円ででの為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ・ AI技術に関わる成長期待からテクノロジー関連銘柄への物色が継続したほか、底堅い景気を背景に業績の上方修正が続き、株価が上昇したこと ・ 円が米ドル、ユーロに対し下落したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・ 米国の地方銀行の破綻をきっかけにグローバルでリスクオフ（リスク回避）の展開が強まったこと

▶ 投資環境について（2022年12月1日から2023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

2022年末にかけては、世界の主要中央銀行が大幅利上げを実施したことで世界経済の先行き不透明感が高まり、株式市場は下落しました。

2023年に入り、インフレ圧力の継続や米国地方銀行の破綻を受けたグローバルの金融リスクの高まりを受け、株式市場では不安定な動きが続きました。

その後、AI技術に関わる成長期待から、テクノロジー関連銘柄を中心に物色が進んだこと、消費者物価指数が鈍化する中、利上げは最終局面にあるとの見方が相場を下支えしました。

8月から10月にかけては、格付け会社による米国債の格下げや雇用統計など底堅い景気指標などをきっかけとした長期金利（10年国債利回り）の上昇が重石となりました。

期末はF R B（米連邦準備制度理事会）議長が追加利上げへ慎重な姿勢を見せ、長期金利が低下に転じたことから反発しました。

為替市場

米ドル・円は米ドル高・円安となりました。総じて堅調な経済指標が続く中、F R Bの利上げ継続観測が強まる一方、緩和姿勢を維持する日銀との金融政策の方向性の違いが意識されました。日銀の政策修正への警戒感が強まったことから一時米ドル安・円高となる局面もありました。

ユーロ・円はユーロ高・円安となりました。E C B（欧州中央銀行）高官による利上げ継続に前向きな姿勢が見られた一方、日銀は金融緩和姿勢を維持したことから、ユーロ高・円安が進行しました。

▶ポートフォリオについて（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

株式組入比率

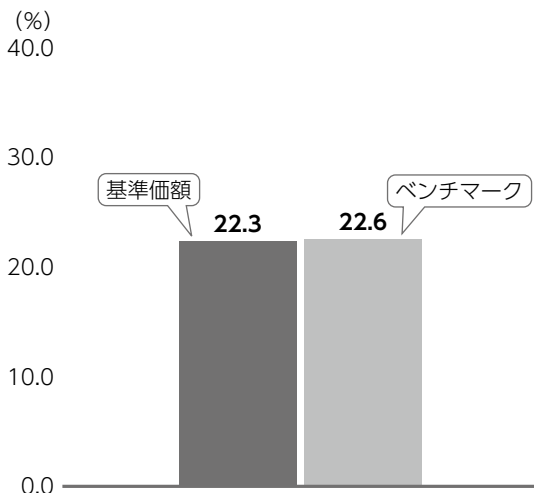
MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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

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

▶ベンチマークとの差異について（2022年12月1日から2023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、円換算ベース）をベンチマークとしています。

記載のグラフは、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+22.3%となり、ベンチマークの騰落率+22.6%から0.3%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストが生じたこと

2 今後の運用方針

引き続き、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。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（2022年12月1日から2023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） （投資信託証券）	3円 （3） （1） （0）	0.005% （0.004） （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）	5 （4） （0）	0.007 （0.007） （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 （22） （0）	0.033 （0.033） （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 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	30	0.045	

期中の平均基準価額は66,511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の状況 (2022年12月1日から2023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 44,254.7 (738.63)	千アメリカ・ドル 441,317 (△ 8,847)	百株 5,349.84	千アメリカ・ドル 17,233
	カ ナ ダ	百株 5,343.16 (64.64)	千カナダ・ドル 29,602 (△ 1,345)	百株 637.87	千カナダ・ドル 730
	オーストラリア	百株 9,402.24 (△ 341.43)	千オーストラリア・ドル 19,975 ()	百株 1,420.54	千オーストラリア・ドル 2,190
	香 港	百株 7,880	千香港・ドル 32,417	百株 1,170	千香港・ドル 1,592
	シンガポール	百株 19,717 (18,016.27)	千シンガポール・ドル 3,879 ()	百株 217	千シンガポール・ドル 283
	ニュージーランド	百株 2,075.18	千ニュージーランド・ドル 2,028	百株 1,322.1	千ニュージーランド・ドル 948
	イギリス	百株 32,720.28 (△ 1,077.8)	千イギリス・ポンド 23,155 (△ 518)	百株 4,111.49	千イギリス・ポンド 2,543
	イスラエル	百株 722.64	千イスラエル・シェケル 3,176	百株 1,929.04	千イスラエル・シェケル 2,483
	スイス	百株 2,255.98 (419.28)	千スイス・フラン 15,669 (△ 196)	百株 4,187.68	千スイス・フラン 1,067
	デンマーク	百株 520.68 (1,227.85)	千デンマーク・クローネ 32,928 ()	百株 64.84	千デンマーク・クローネ 1,095
	ノルウェー	百株 773.74 ()	千ノルウェー・クローネ 11,002 (△ 23)	百株 -	千ノルウェー・クローネ -
	国	スウェーデン	百株 4,813.15 (341.71)	千スウェーデン・クローナ 68,722 ()	百株 3,055.53
ユ ー ロ		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
アイルランド		1,854.05	2,149	551.74	2,826
オランダ		1,846.75 (969.05)	10,066 (△ 29)	375.46	2,172
ベルギー		214.35	1,510	114	190
ルクセンブルグ		152.38	209	769.56	152
	フランス	2,803.04 ()	18,150 (△ 42)	752.28	1,578

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	ド イ ツ	2,923.99 (-)	14,510 (△ 244)	164.9	453
	ポ ル ト ガ ル	760.27	605	337.5	307
	ス ペ イ ン	4,691.49 (△ 133.3)	3,788 (△ 7)	628.02	582
	イ タ リ ア	3,583.01 (-)	2,470 (△ 1)	491.49	927
	フ ィ ン ラ ン ド	1,560.29 (364.23)	2,041 (-)	429.21	205
	オ ー ス ト リ ア	207.98	796	115.25	506
	そ の 他	139.15 (-)	1,629 (△ 19)	-	-

※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。

(2) 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		千アメリカ・ドル		千アメリカ・ドル
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,149	198	-	-
	SIMON PROPERTY GROUP INC	3,695	434	-	-
	VORNADO REALTY TRUST	-	-	8,706	220
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,035	229	-	-
	EQUITY RESIDENTIAL	3,519	220	-	-
	EQUINIX INC	1,033	786	-	-
	AMERICAN TOWER CORP	6,119	1,280	-	-
	SUN COMMUNITIES INC	2,989	407	-	-
	HOST HOTELS & RESORTS INC	13,088	240	-	-
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	6,197	212	-	-
	REALTY INCOME CORP	13,198	819	-	-
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,701	247	-	-
	INVITATION HOMES INC	7,859	266	-	-
	VICI PROPERTIES INC	16,298	538	-	-
	KIMCO REALTY CORP	9,655	221	-	-
	NET LEASE OFFICE PROPERTY	- (1,118)	- (-)	1,118 (-)	12 (-)
	VENTAS INC	4,979	231	-	-
	WEYERHAEUSER CO	6,906	215	-	-
	CROWN CASTLE INC	6,098	764	-	-
	IRON MOUNTAIN INC	4,115	261	-	-
	PROLOGIS INC	10,103	1,265	-	-
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,570	492	-	-
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,852	212	-	-	
WELLTOWER INC	10,214	773	-	-	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,070	193	-	-	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	12,664	274	-	-	

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		PUBLIC STORAGE	1,572	476	—	—	
		REGENCY CENTERS CORP	3,493	217	—	—	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	4,339	527	—	—	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,798	1,023	—	—	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	16,934	218	48,792	402	
		WP CAREY INC	5,711	422	—	—	
	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	
			LENLEASE GROUP	27,389	216	—	—
			TRANSURBAN GROUP	45,857	649	—	—
			APA GROUP	14,093	141	—	—
			MIRVAC GROUP	75,244	175	—	—
			STOCKLAND	66,431	252	—	—
			GOODMAN GROUP	27,697	616	—	—
	香 港		□	千香港・ドル	□	千香港・ドル	
			HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	—	193,500	967
			LINK REIT	52,800	2,735	—	—
		LINK REIT-RIGHTS	—	—	27,320	—	
			(27,320)	(—)	(—)	(—)	
	シンガポール		□	千シンガポール・ドル	□	千シンガポール・ドル	
			CAPITALAND ASCENDAS REIT	48,000	133	—	—
				(—)	(△ 4)	(—)	(—)
			CAPITALAND INTEGRATED COMMER	105,200	218	—	—
				(—)	(△ 1)	(—)	(—)
			MAPLETREE LOGISTICS TRUST	—	—	—	—
				(—)	(△ 8)	(—)	(—)
イギリス		□	千イギリス・ポンド	□	千イギリス・ポンド		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	19,996	149	—	—	
		SEGRO PLC	10,423	79	—	—	
		BRITISH LAND CO PLC	—	—	49,008	158	
			—	—	—	—	
			(18,880)	(—)	(—)	(—)	
ユ ーロ	ベルギー フランス	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,674	199	4,169	120	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,918	120	—	—	
		KLEPIERRE	4,572	109	—	—	
			(—)	(△ 11)	(—)	(—)	

※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。

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 128,458	百万円 139,916	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

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	90,081,144千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	498,612,728千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.18

※(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12月1日から2023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

(2022年12月1日から2023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。

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2023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	72.44	89.63	1,708	251,299	商業・専門サービス
FIRST SOLAR INC	—	68.59	1,066	156,790	半導体・半導体製造装置
ARTHUR J GALLAGHER & CO	130.3	165.77	4,061	597,353	保険
ABBOTT LABORATORIES	1,108.13	1,314.77	13,624	2,003,823	ヘルスケア機器・サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	42.03	47.59	2,202	323,867	素材
VERISK ANALYTICS INC	96.74	113.54	2,705	397,854	商業・専門サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	28.44	34.32	1,369	201,443	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LAS VEGAS SANDS CORP	234.49	279.77	1,268	186,554	消費者サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	28.87	33.99	1,877	276,169	半導体・半導体製造装置
SVB FINANCIAL GROUP	37.27	—	—	—	銀行
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	382.49	427.49	2,487	365,783	金融サービス
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	17.45	21	4,597	676,100	消費者サービス
AFLAC INC	377.79	446.28	3,642	535,773	保険
DARDEN RESTAURANTS INC	76.06	93.23	1,451	213,526	消費者サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	260.21	600.52	3,285	483,190	食品・飲料・タバコ
ADOBE INC	302.05	340.76	21,038	3,094,085	ソフトウェア・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	140.2	140.2	1,047	154,128	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	72.14	83.57	3,663	538,760	耐久消費財・アパレル
GARMIN LTD	107.74	107.74	1,303	191,728	耐久消費財・アパレル
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	136.78	170.56	4,545	668,445	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	434.97	505.21	9,814	1,443,375	資本財
WR BERKLEY CORP	144.86	144.86	1,022	150,346	保険
AUTOZONE INC	12.12	13.15	3,414	502,157	一般消費財・サービス流通・小売り
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	738.73	822.14	796	117,163	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DR HORTON INC	209.92	240.3	3,058	449,748	耐久消費財・アパレル
DENTSPLY SIRONA INC	118.64	177.15	555	81,625	ヘルスケア機器・サービス
AUTODESK INC	133.58	161.46	3,452	507,806	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	166.41	212.04	1,058	155,736	公益事業
CITIGROUP INC	1,207.48	1,438.67	6,581	968,002	銀行
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	63.59	63.59	722	106,184	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	269.47	305.87	7,009	1,030,860	商業・専門サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	318.24	373.02	2,954	434,573	公益事業
HESS CORP	179.13	211.98	2,958	435,090	エネルギー
DAVITA INC	41.38	41.38	412	60,620	ヘルスケア機器・サービス
DOMINO'S PIZZA INC	21.21	28.75	1,117	164,420	消費者サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	353.37	416.49	4,693	690,262	金融サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	365.18	422.89	3,095	455,201	食品・飲料・タバコ
BUNGE LTD	102.63	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TE CONNECTIVITY LTD	198.05	231.94	3,025	444,915	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	10,249.49	11,787.3	223,216	32,828,391	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	186.45	186.45	1,657	243,747	金融サービス
BOEING CO/THE	353.54	433.59	9,731	1,431,147	資本財
CINCINNATI FINANCIAL CORP	105.1	105.1	1,057	155,590	保険
BECTON DICKINSON AND CO	184.31	210.72	4,966	730,417	ヘルスケア機器・サービス
NISOURCE INC	258.29	348.55	899	132,305	公益事業
ABBVIE INC	1,124.3	1,330.33	18,425	2,709,775	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,671.77	3,185.19	12,027	1,768,851	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		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	814.17	971.22	34,836	5,123,432	金融サービス
KINDER MORGAN INC	1,273.94	1,561.97	2,705	397,873	エネルギー
TRUIST FINANCIAL CORP	832.28	1,016.87	3,267	480,507	銀行
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,358.37	1,593.54	7,763	1,141,811	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	190.58	190.58	845	124,418	保険
CBOE GLOBAL MARKETS INC	73.23	73.23	1,314	193,320	金融サービス
JPMORGAN CHASE & CO	1,865.39	2,198.09	33,920	4,988,750	銀行
T ROWE PRICE GROUP INC	136.63	173.03	1,715	252,337	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	14.94	18.71	2,011	295,833	ソフトウェア・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	28.88	28.88	675	99,282	資本財
THE CIGNA GROUP	203.47	223.35	5,871	863,477	ヘルスケア機器・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	189.5	226.43	1,318	193,912	食品・飲料・タバコ
CADENCE DESIGN SYS INC	174.92	203.18	5,591	822,373	ソフトウェア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	71.31	79.78	2,779	408,727	金融サービス
MERCADOLIBRE INC	28.89	33.84	5,450	801,561	一般消費財・サービス流通・小売り
DOLLAR GENERAL CORP	142.55	158	2,036	299,479	生活必需品流通・小売り
SERVICENOW INC	129.25	154.73	10,505	1,544,982	ソフトウェア・サービス
CATERPILLAR INC	340.65	390.51	9,741	1,432,648	資本財
BROWN & BROWN INC	142.73	184.24	1,344	197,720	保険
CHARLES RIVER LABORATORIES	34.67	34.67	683	100,499	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	366.96	403	2,840	417,729	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	517.62	584.7	1,650	242,668	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	55.3	63.08	1,148	168,890	運輸
MOSAIC CO/THE	213.06	254.89	928	136,526	素材
CISCO SYSTEMS INC	2,640.08	3,046.23	14,637	2,152,683	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MORGAN STANLEY	830.31	924.28	7,260	1,067,760	金融サービス
BROADCOM INC	257.42	332.29	31,262	4,597,825	半導体・半導体製造装置
DELL TECHNOLOGIES -C	187.97	187.97	1,410	207,501	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DTE ENERGY COMPANY	120.57	162.77	1,695	249,296	公益事業
DOMINION ENERGY INC	526.1	605.34	2,828	416,024	公益事業
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	79.12	91.71	1,504	221,213	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DEERE & CO	185.94	207.18	7,540	1,108,923	資本財
VMWARE INC-CLASS A	138.09	-	-	-	ソフトウェア・サービス
BLACKSTONE INC	453.04	532.94	5,935	872,912	金融サービス
DICK'S SPORTING GOODS INC	-	44.06	563	82,910	一般消費財・サービス流通・小売り
NASDAQ INC	229.24	279.99	1,559	229,362	金融サービス
ZOETIS INC	294.34	342.74	6,025	886,100	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONSOLIDATED EDISON INC	221.6	252.3	2,269	333,729	公益事業
KKR & CO INC	373.08	472.24	3,529	519,086	金融サービス
COGNEX CORP	86.98	113.68	427	62,879	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALPHABET INC-CL C	3,569.93	3,965.9	54,094	7,955,733	メディア・娯楽
COLGATE-PALMOLIVE CO	500.68	589.56	4,591	675,270	家庭用品・パーソナル用品
HCA HEALTHCARE INC	145.75	150.58	3,750	551,607	ヘルスケア機器・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	226.62	266.47	8,280	1,217,860	ヘルスケア機器・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	171.44	192.14	1,806	265,625	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	281.36	334.32	19,653	2,890,416	生活必需品流通・小売り
AECOM	-	102.61	900	132,497	資本財
CUMMINS INC	91.44	101.59	2,275	334,600	資本財
ACTIVISION BLIZZARD INC	506.81	-	-	-	メディア・娯楽
DELTA AIR LINES INC	82.99	141.92	519	76,475	運輸
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	87.26	87.26	711	104,681	運輸

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	118.11	133.2	1,836	270,103	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COTERRA ENERGY INC	499.08	597.41	1,558	229,229	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	33.74	41.65	3,968	583,646	資本財
MASIMO CORP	29.41	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	42.65	45.12	4,394	646,286	一般消費財・サービス流通・小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	462.12	528.08	1,055	155,174	生活必需品流通・小売り
SEAGEN INC	89.54	103.28	2,205	324,323	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COCA-COLA CO/THE	2,620.91	3,098.73	18,043	2,653,717	食品・飲料・タバコ
ENTEGRIS INC	99.61	99.61	1,041	153,103	半導体・半導体製造装置
EXPEDITORS INTL WASH INC	104.36	104.36	1,247	183,441	運輸
BURLINGTON STORES INC	48.02	48.02	823	121,132	一般消費財・サービス流通・小売り
FRANKLIN RESOURCES INC	217.78	217.78	535	78,759	金融サービス
CSX CORP	1,372.54	1,548.35	4,912	722,542	運輸
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	62.45	62.45	1,336	196,631	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDIA GROUP INC	100.81	100.81	1,368	201,264	消費者サービス
AMAZON.COM INC	5,804.71	6,920.35	101,258	14,892,096	一般消費財・サービス流通・小売り
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	390.84	440.49	2,970	436,830	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	2,672.58	3,001.85	30,720	4,518,127	エネルギー
EVEREST GROUP LTD	27.55	35.47	1,427	209,883	保険
EOG RESOURCES INC	370.69	438.3	5,401	794,414	エネルギー
EQT CORP	192.98	264.11	1,049	154,399	エネルギー
AKAMI TECHNOLOGIES INC	103	103	1,191	175,264	ソフトウェア・サービス
CENCORA INC	102.49	122.09	2,435	358,253	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	195.56	231.21	2,950	433,857	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FORD MOTOR CO	2,562.95	2,992	3,168	465,995	自動車・自動車部品
HORMEL FOODS CORP	194.75	255.36	778	114,432	食品・飲料・タバコ
LIBERTY GLOBAL HOLDINGS LTD/	84.32	—	—	—	電気通信サービス
KRAFT HEINZ CO/THE	441.24	622.28	2,182	321,047	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	117.21	151.91	1,993	293,163	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	221.16	253.75	1,515	222,831	公益事業
PAYPAL HOLDINGS INC	707.71	803.3	4,656	684,865	金融サービス
MSCI INC	50.79	62.23	3,276	481,925	金融サービス
FORTINET INC	433.92	476.04	2,551	375,260	ソフトウェア・サービス
ALLY FINANCIAL INC	201.39	201.39	576	84,827	金融サービス
ELEVANCE HEALTH INC	151.16	174.96	8,141	1,197,434	ヘルスケア機器・サービス
NEXTERA ENERGY INC	1,254.22	1,519.7	8,868	1,304,359	公益事業
PALO ALTO NETWORKS INC	186.42	228.21	6,593	969,664	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC	394.41	413.44	6,182	909,333	電気通信サービス
ELECTRONIC ARTS INC	183.78	194.28	2,667	392,332	メディア・娯楽
FREEMPORT-MCMORAN INC	941.69	1,067.89	3,969	583,771	素材
SYNCHRONY FINANCIAL	321.12	321.12	1,002	147,443	金融サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	343.63	326.36	4,811	707,583	エネルギー
KEURIG DR PEPPER INC	469.03	681.47	2,162	318,010	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	913.39	1,161.2	4,388	645,368	銀行
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	861.38	1,026.47	1,695	249,390	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	39.21	39.21	666	98,061	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OLD DOMINION FREIGHT LINE	62.92	76.77	2,947	433,456	運輸
FASTENAL CO	370.51	415.51	2,478	364,454	資本財
FISERV INC	379.74	469.55	6,074	893,317	金融サービス
GENERAL ELECTRIC CO	707.21	826.51	9,823	1,444,800	資本財
ALIGN TECHNOLOGY INC	49.14	57.03	1,234	181,570	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	
PAYCOM SOFTWARE INC	30.07	37.78	684	100,730	商業・専門サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	139.45	—	—	—	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	75.5	436	64,268	金融サービス
TRANSUNION	112.33	145.03	852	125,396	商業・専門サービス
MATCH GROUP INC	177.99	177.99	578	85,022	メディア・娯楽
GODADDY INC - CLASS A	89.05	118.95	1,164	171,301	ソフトウェア・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	42.41	52.76	1,840	270,741	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO	871.13	1,043.01	3,295	484,729	自動車・自動車部品
DIAMONDBACK ENERGY INC	110.49	130.65	2,009	295,502	エネルギー
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	71.66	106.48	724	106,550	資本財
HOLOGIC INC	165.91	197.3	1,392	204,859	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	148.67	177.78	4,352	640,135	資本財
GOLDMAN SACHS GROUP INC	219.77	249.77	8,498	1,249,899	金融サービス
FIRST HORIZON CORP	—	390.14	493	72,583	銀行
ALPHABET INC-CL A	3,806.93	4,452.27	60,101	8,839,082	メディア・娯楽
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	42.03	42.03	570	83,911	ヘルスケア機器・サービス
WABTEC CORP	112.84	127.82	1,472	216,558	資本財
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	32.57	41.89	991	145,775	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIRST REPUBLIC BANK/CA	109.7	—	—	—	銀行
CELANESE CORP	66.43	87.42	1,201	176,704	素材
VAIL RESORTS INC	28.6	28.6	615	90,525	消費者サービス
MOLINA HEALTHCARE INC	34.28	46.73	1,639	241,103	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	72.56	76.01	3,032	445,921	メディア・娯楽
GENERAL MILLS INC	373.27	422.68	2,645	389,081	食品・飲料・タバコ
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	135.99	155.37	1,769	260,310	ヘルスケア機器・サービス
FIRSTENERGY CORP	319.66	379.7	1,404	206,505	公益事業
GENUINE PARTS CO	87.11	102.45	1,371	201,691	一般消費財・サービス流通・小売り
FORTIVE CORP	219.81	250.83	1,698	249,779	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	424.45	495.41	1,407	206,995	銀行
XYLEM INC	122.01	168.31	1,742	256,197	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	119.65	143.88	2,714	399,212	資本財
LKQ CORP	159.22	189.82	842	123,922	一般消費財・サービス流通・小売り
HALLIBURTON CO	548.52	675.81	2,520	370,729	エネルギー
TELADOC HEALTH INC	74.96	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	650.45	751.03	23,358	3,435,339	一般消費財・サービス流通・小売り
ALBEMARLE CORP	74.33	83.38	1,028	151,297	素材
CDW CORP/DE	86.21	98.55	2,090	307,397	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	31.14	31.14	510	75,016	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	881.61	1,050.07	1,168	171,884	銀行
HERSHEY CO/THE	89.25	111.8	2,076	305,368	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	80.18	94.98	4,581	673,864	ヘルスケア機器・サービス
BLOCK INC	314.99	384.43	2,449	360,317	金融サービス
IQVIA HOLDINGS INC	124.01	144.39	3,087	454,034	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPLUNK INC	97.92	122.34	1,842	270,967	ソフトウェア・サービス
S&P GLOBAL INC	217.47	248.87	10,319	1,517,636	金融サービス
MARKETAXESS HOLDINGS INC	26.53	26.53	628	92,506	金融サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	303.66	361.22	983	144,711	銀行
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	41.41	—	—	—	メディア・娯楽
HP INC	697.11	664.19	1,930	283,962	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	49.71	49.71	775	114,056	金融サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	563.97	688.71	10,772	1,584,254	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	
HUBBELL INC	—	38.97	1,148	168,879	資本財
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	83.42	103.15	1,788	262,991	ヘルスケア機器・サービス
SNAP INC - A	640.99	706.89	917	134,943	メディア・娯楽
TARGA RESOURCES CORP	123.5	154.16	1,356	199,539	エネルギー
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	107.72	126.52	1,986	292,153	メディア・娯楽
LEIDOS HOLDINGS INC	88.63	88.63	941	138,455	商業・専門サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	304.9	342.01	2,443	359,338	素材
LIBERTY GLOBAL PLC-C	210.79	—	—	—	電気通信サービス
BLACK KNIGHT INC	106.56	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	79.4	120.89	643	94,639	運輸
JUNIPER NETWORKS INC	174.6	211.51	593	87,223	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JM SMUCKER CO/THE	66.47	81.72	887	130,497	食品・飲料・タバコ
INGERSOLL-RAND INC	250.11	293.14	2,040	300,060	資本財
JOHNSON & JOHNSON	1,665.36	1,804.42	27,447	4,036,635	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ON SEMICONDUCTOR	278.91	312.06	2,234	328,697	半導体・半導体製造装置
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	33.19	41.04	322	47,410	半導体・半導体製造装置
HOWMET AEROSPACE INC	238.89	277.83	1,433	210,799	資本財
QORVO INC	60.42	78.35	751	110,493	半導体・半導体製造装置
IDEXX LABORATORIES INC	55.48	60.43	2,820	414,812	ヘルスケア機器・サービス
ARISTA NETWORKS INC	148.47	202.86	4,448	654,273	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EXACT SCIENCES CORP	97.71	135.7	882	129,842	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EVERGY INC	133.33	172.75	874	128,657	公益事業
RINGCENTRAL INC-CLASS A	39.92	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	106.77	106.77	1,024	150,745	半導体・半導体製造装置
KIMBERLY-CLARK CORP	213.36	253.78	3,090	454,487	家庭用品・パーソナル用品
NORDSON CORP	28.84	39.27	913	134,336	資本財
PAYLOCITY HOLDING CORP	—	27.18	421	61,971	商業・専門サービス
KROGER CO	419.15	498.9	2,177	320,200	生活必需品流通・小売り
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	110.8	110.8	926	136,229	メディア・娯楽
POOL CORP	25.78	32.52	1,122	165,156	一般消費財・サービス流通・小売り
CAESARS ENTERTAINMENT INC	133.36	158.81	715	105,172	消費者サービス
DOCUSIGN INC	120.31	171.64	748	110,110	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS B	87.73	87.73	242	35,726	メディア・娯楽
DOW INC	445.43	538.62	2,764	406,609	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	52.2	86.88	825	121,398	金融サービス
CBRE GROUP INC - A	207.93	235.02	1,865	274,372	不動産管理・開発
COUPA SOFTWARE INC	34.9	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AXON ENTERPRISE INC	—	46.72	1,055	155,190	資本財
KLA CORP	94.74	100.49	5,467	804,084	半導体・半導体製造装置
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	139.27	183.07	1,243	182,949	ソフトウェア・サービス
COPART INC	275.84	621.64	3,121	459,134	商業・専門サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	70.72	80.71	1,615	237,625	一般消費財・サービス流通・小売り
NRG ENERGY INC	135.47	203.49	953	140,209	公益事業
TWILIO INC - A	109.05	109.05	721	106,059	ソフトウェア・サービス
CORTEVA INC	444.4	539	2,452	360,681	素材
LOCKHEED MARTIN CORP	153.36	170.95	7,607	1,118,827	資本財
IDEX CORP	47.88	60.48	1,199	176,383	資本財
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12.88	22.44	643	94,707	保険
EPAM SYSTEMS INC	37.33	48.15	1,261	185,519	ソフトウェア・サービス
LENNOX INTERNATIONAL INC	21.04	21.04	844	124,129	資本財
EQUITABLE HOLDINGS INC	228.2	228.2	683	100,549	金融サービス

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	
GLOBAL PAYMENTS INC	181.57	205.94	2,396	352,426	金融サービス
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	49.92	61.64	1,336	196,555	金融サービス
RESMED INC	87.75	107.58	1,708	251,329	ヘルスケア機器・サービス
BATH & BODY WORKS INC	154	154	493	72,589	一般消費財・サービス流通・小売り
DATADOG INC - CLASS A	140.23	189.11	2,205	324,431	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	257.77	257.77	900	132,382	公益事業
GENERAC HOLDINGS INC	39.73	39.73	459	67,546	資本財
LOWE'S COS INC	400.32	438.14	8,759	1,288,229	一般消費財・サービス流通・小売り
UNITED RENTALS INC	47.98	53.83	2,563	377,012	資本財
ELI LILLY & CO	511.14	606.86	35,917	5,282,403	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	80.29	106.37	1,323	194,718	商業・専門サービス
LAM RESEARCH CORP	85.5	102.43	7,313	1,075,581	半導体・半導体製造装置
REPLIGEN CORP	—	34.56	551	81,064	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OKTA INC	103.37	103.37	731	107,588	ソフトウェア・サービス
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	—	110.73	653	96,179	半導体・半導体製造装置
LOEWS CORP	127.27	127.27	871	128,234	保険
BIO-RAD LABORATORIES-A	12.2	17.28	526	77,382	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARKEL GROUP INC	8.37	9.57	1,354	199,178	保険
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	130.21	169.59	3,975	584,730	ソフトウェア・サービス
GEN DIGITAL INC	417.79	417.79	909	133,764	ソフトウェア・サービス
ROLLINS INC	160.81	160.81	646	95,050	商業・専門サービス
ETSY INC	71.68	90.9	701	103,206	一般消費財・サービス流通・小売り
DYNATRACE INC	95.87	157.53	841	123,786	ソフトウェア・サービス
LINCOLN NATIONAL CORP	86.77	—	—	—	保険
PLUG POWER INC	285.84	—	—	—	資本財
MCDONALD'S CORP	468.04	542.94	15,222	2,238,839	消費者サービス
BILL HOLDINGS INC	60.04	60.04	407	59,991	ソフトウェア・サービス
CABLE ONE INC	3.88	—	—	—	メディア・娯楽
3M CO	351.01	424.82	4,183	615,223	資本財
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,451.52	1,658.62	55,099	8,103,462	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	83.02	103.81	1,048	154,139	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	59.08	67.63	2,021	297,256	ソフトウェア・サービス
COSTAR GROUP INC	251.16	308.36	2,588	380,672	不動産管理・開発
IAC INC	39.74	—	—	—	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	147.43	203.23	3,563	524,014	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	144.87	144.87	811	119,313	商業・専門サービス
VIATRIS INC	834.66	834.66	762	112,073	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOORDASH INC - A	116.27	201.42	1,912	281,298	消費者サービス
ZSCALER INC	45.51	62.71	1,253	184,307	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	149.28	165.87	2,535	372,943	資本財
MODERNA INC	219.41	237.9	1,879	276,439	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLAR TREE INC	139.92	159.23	1,928	283,638	生活必需品流通・小売り
FOX CORP - CLASS A	169.62	238.86	706	103,911	メディア・娯楽
PHILLIPS 66	312.8	338.14	4,132	607,803	エネルギー
ROBLOX CORP -CLASS A	227.45	298.46	1,154	169,783	メディア・娯楽
MGM RESORTS INTERNATIONAL	221.98	221.98	875	128,725	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	151.62	184.25	1,184	174,183	食品・飲料・タバコ
APA CORP	197.59	197.59	717	105,515	エネルギー
METLIFE INC	437.46	475.92	3,005	442,079	保険
MOTOROLA SOLUTIONS INC	106.92	127.84	4,078	599,840	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCKWELL AUTOMATION INC	70.31	86.78	2,347	345,308	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	
MERCK & CO. INC.	1,609.11	1,912.52	19,341	2,844,527	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	898	132,158	資本財
MARSH & MCLENNAN COS	317.65	365.69	7,179	1,055,902	保険
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	496.81	611	2,905	427,283	金融サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	181.85	196.65	3,981	585,598	消費者サービス
WORKDAY INC-CLASS A	120.69	155.69	4,102	603,321	ソフトウェア・サービス
DARLING INGREDIENTS INC	-	105.14	437	64,387	食品・飲料・タバコ
BAKER HUGHES CO	609.81	780.82	2,603	382,860	エネルギー
MARVELL TECHNOLOGY INC	533.45	651.12	3,652	537,214	半導体・半導体製造装置
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	-	98.01	1,322	194,434	資本財
CHENIERE ENERGY INC	149.77	177.54	3,203	471,143	エネルギー
QUANTA SERVICES INC	88.91	104.16	1,933	284,332	資本財
NETAPP INC	132.73	170.45	1,526	224,459	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NIKE INC -CL B	811.97	935.16	10,321	1,517,962	耐久消費財・アパレル
NORFOLK SOUTHERN CORP	150.62	170.33	3,663	538,784	運輸
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	364.42	401.24	3,329	489,668	半導体・半導体製造装置
AFFIRM HOLDINGS INC	90.77	-	-	-	金融サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	72.52	136.34	1,742	256,298	金融サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	95.11	109.37	5,112	751,831	資本財
NEWMONT CORP	508.98	863.38	3,486	512,734	素材
MCKESSON CORP	94.17	100.67	4,597	676,168	ヘルスケア機器・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL NUCOR CORP	990.61 174.84	1,175.73 189.97	11,010 3,111	1,619,345 457,583	食品・飲料・タバコ 素材
DECKERS OUTDOOR CORP	-	18.72	1,226	180,328	耐久消費財・アパレル
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	276.58	-	-	-	メディア・娯楽
WESTERN UNION CO	218.4	-	-	-	金融サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	193.54	456.98	791	116,404	自動車・自動車部品
NEWELL BRANDS INC	269.97	-	-	-	耐久消費財・アパレル
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	586.43	519.61	3,134	461,036	エネルギー
ROBINHOOD MARKETS INC - A	-	319.65	285	41,933	金融サービス
LUCID GROUP INC	217.3	822.93	358	52,768	自動車・自動車部品
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	242.07	311.81	2,877	423,130	金融サービス
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	6.7	8.45	1,218	179,249	銀行
WEBSTER FINANCIAL CORP	96	139.18	619	91,169	銀行
CONSTELLATION ENERGY	202.34	250.08	3,015	443,484	公益事業
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,361.45	1,659.16	1,788	263,045	メディア・娯楽
DRAFTKINGS INC-CL A	-	322.65	1,234	181,599	消費者サービス
APPLOVIN CORP-CLASS A	89.26	-	-	-	ソフトウェア・サービス
ALCOA CORP	118.49	-	-	-	素材
TOAST INC-CLASS A	-	213.93	326	48,043	金融サービス
ARES MANAGEMENT CORP - A	-	113.7	1,263	185,863	金融サービス
CARLISLE COS INC	34.99	34.99	962	141,571	資本財
PAYCHEX INC	208.31	249.17	3,018	443,959	商業・専門サービス
ALTRIA GROUP INC	1,164.8	1,345.04	5,616	826,075	食品・飲料・タバコ
P G & E CORP	918.94	1,492.97	2,563	377,003	公益事業
PFIZER INC	3,564.55	4,199.49	12,632	1,857,797	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	335.65	407.56	2,445	359,639	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	80.47	96.07	4,112	604,806	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	145.47	175.16	4,026	592,188	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE EXELON CORP	1,518.47 643.53	1,774.16 762.92	26,812 2,928	3,943,370 430,745	家庭用品・パーソナル用品 公益事業

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
NVR INC	1.73	2.5	1,526	224,543	耐久消費財・アパレル
CONOCOPHILLIPS	825.11	917.05	10,451	1,537,119	エネルギー
ABIOMED INC	27.31	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC	879.89	1,038.27	17,355	2,552,505	食品・飲料・タバコ
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	229.33	272.29	2,630	386,841	保険
ACCENTURE PLC-CL A	404.16	476.44	15,881	2,335,714	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	82.2	115.09	733	107,854	資本財
QUALCOMM INC	716.9	832.12	10,643	1,565,361	半導体・半導体製造装置
ADVANCE AUTO PARTS INC	34.26	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	164.09	194.58	1,443	212,251	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	68.37	80.98	6,547	963,008	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REPUBLIC SERVICES INC	142.32	160.65	2,569	377,863	商業・専門サービス
BOOKING HOLDINGS INC	26.17	27.88	8,716	1,281,876	消費者サービス
ROSS STORES INC	222.58	247.02	3,191	469,373	一般消費財・サービス流通・小売り
PACKAGING CORP OF AMERICA	55.5	71.11	1,150	169,265	素材
QUEST DIAGNOSTICS INC	68.14	76.45	1,034	152,090	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INC	81.49	81.49	655	96,477	商業・専門サービス
RPM INTERNATIONAL INC	76.96	103.97	1,052	154,835	素材
REVVITY INC	83.23	104.11	930	136,899	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEICO CORP	30.85	30.85	520	76,572	資本財
HEICO CORP-CLASS A	45.7	45.7	621	91,400	資本財
REGIONS FINANCIAL CORP	629.79	629.79	1,037	152,550	銀行
TEXAS PACIFIC LAND CORP	4.17	4.17	688	101,318	エネルギー
AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	276.58	—	—	—	メディア・娯楽
CHEVRON CORP	1,181.31	1,364.57	19,637	2,888,091	エネルギー
JACOBS SOLUTIONS INC	84.22	103.93	1,311	192,896	商業・専門サービス
EDISON INTERNATIONAL	246.55	278.15	1,829	269,089	公益事業
TESLA INC	1,671.95	2,142.41	52,304	7,692,466	自動車・自動車部品
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	58.5	58.5	313	46,158	運輸
CHESAPEAKE ENERGY CORP	—	76.95	613	90,270	エネルギー
HF SINCLAIR CORP	—	106.63	562	82,691	エネルギー
ASPEN TECHNOLOGY INC	—	19.01	354	52,164	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	91.29	108.69	994	146,199	資本財
OVINTIV INC	—	166.72	732	107,689	エネルギー
SYNOPSYS INC	93.83	116.69	6,446	948,109	ソフトウェア・サービス
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	—	311.6	2,109	310,294	ヘルスケア機器・サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	35.37	820	120,719	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GRACO INC	—	116.45	932	137,181	資本財
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	—	40.56	1,096	161,208	素材
TORO CO	—	80.97	668	98,255	資本財
LINDE PLC	—	369.66	15,207	2,236,558	素材
WATSCO INC	—	23.64	899	132,272	資本財
SOUTHERN CO/THE	685.72	809.27	5,683	835,872	公益事業
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	—	123.83	333	49,062	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	—	134.38	851	125,259	メディア・娯楽
SYSCO CORP	311.26	363.52	2,606	383,382	生活必需品流通・小売り
KENVUE INC	—	1,126.11	2,261	332,558	家庭用品・パーソナル用品
MANHATTAN ASSOCIATES INC	—	46.48	1,039	152,855	ソフトウェア・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	150.31	167.19	2,966	436,300	保険
VERALTO CORP	—	176.4	1,309	192,550	商業・専門サービス
SIGNATURE BANK	43.35	—	—	—	銀行

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SUPER MICRO COMPUTER INC	—	35.4	1,018	149,748	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SCHLUMBERGER LTD	894.55	1,051.97	5,456	802,497	エネルギー
AT&T INC	4,577.81	5,345.92	8,713	1,281,545	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	70.76	140.57	356	52,366	運輸
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE SEMPRA	151.87 199	182.66 488.38	4,999 3,562	735,316 523,971	素材 公益事業
TYLER TECHNOLOGIES INC	24.06	31.39	1,278	188,035	ソフトウェア・サービス
TEXAS INSTRUMENTS INC	588.9	687.25	10,528	1,548,451	半導体・半導体製造装置
SALESFORCE INC	635.19	735.6	16,944	2,492,034	ソフトウェア・サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	428.95	524.7	2,768	407,136	資本財
TERADYNE INC	106.42	106.42	987	145,180	半導体・半導体製造装置
UNION PACIFIC CORP	402.07	455.63	10,090	1,484,059	運輸
MARATHON OIL CORP	423.8	423.8	1,072	157,690	エネルギー
RTX CORP	930.88	1,109.09	8,978	1,320,406	資本財
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	470.01	540.32	8,228	1,210,170	運輸
DEXCOM INC	248.41	302.45	3,513	516,783	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	169.37	199.79	1,538	226,220	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	593.75	700.17	37,457	5,508,903	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	64.25	64.25	1,360	200,040	ソフトウェア・サービス
VALERO ENERGY CORP	258.28	268.05	3,325	489,149	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	32.87	37.34	1,568	230,652	一般消費財・サービス流通・小売り
WALT DISNEY CO/THE	1,161.43	1,383.65	12,798	1,882,314	メディア・娯楽
WELLS FARGO & CO	2,398.83	2,758.47	12,076	1,776,102	銀行
INSULET CORP	42.63	50.82	960	141,200	ヘルスケア機器・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	268.28	302.36	5,132	754,801	商業・専門サービス
WHIRLPOOL CORP	32.12	49.75	545	80,213	耐久消費財・アパレル
WALMART INC	964.31	1,117.44	17,441	2,565,048	生活必需品流通・小売り
WYNN RESORTS LTD	77.3	77.3	646	95,120	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	734.17	850.65	7,494	1,102,175	一般消費財・サービス流通・小売り
WATERS CORP	40.95	40.95	1,145	168,473	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WASTE CONNECTIONS INC	161.22	201.67	2,674	393,405	商業・専門サービス
WESTERN DIGITAL CORP	184.92	245.33	1,160	170,733	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WEC ENERGY GROUP INC	197.74	225.71	1,872	275,420	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	330.85	372.36	2,356	346,594	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	1,041.54	1,217.62	30,955	4,552,633	金融サービス
PPL CORP	471.99	555.23	1,445	212,554	公益事業
PULTEGROUP INC	130.75	175.35	1,543	226,966	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	151.81	167.35	2,335	343,462	素材
NORTHERN TRUST CORP	130.26	167.93	1,314	193,331	金融サービス
NVIDIA CORP	1,588.98	1,851.05	89,109	13,105,341	半導体・半導体製造装置
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	262.02	303.37	4,016	590,634	銀行
TYSON FOODS INC-CL A	197.31	197.31	929	136,647	食品・飲料・タバコ
NETFLIX INC	284.48	331.45	15,816	2,326,127	メディア・娯楽
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	247.75	286.88	14,140	2,079,700	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBE LIFE INC	63.73	63.73	766	112,716	保険
TEXTRON INC	148.7	148.7	1,112	163,648	資本財
NEWS CORP - CLASS A	231.02	231.02	516	75,902	メディア・娯楽
OMNICOM GROUP	125.45	151.06	1,205	177,264	メディア・娯楽
ORACLE CORP	1,003.64	1,229.99	14,293	2,102,176	ソフトウェア・サービス
MASTERCARD INC - A	549.61	630.63	25,844	3,800,947	金融サービス
LUMEN TECHNOLOGIES INC	497.58	—	—	—	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		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ROPER TECHNOLOGIES INC	66.85	80.88	4,252	625,475	ソフトウェア・サービス
YUM! BRANDS INC	180.46	201.79	2,532	372,508	消費者サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	96.29	124.77	749	110,283	食品・飲料・タバコ
BANK OF AMERICA CORP	4,589.12	5,412.47	16,405	2,412,712	銀行
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	115.57	138.32	1,241	182,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN EXPRESS CO	405.11	473.98	7,935	1,167,125	金融サービス
ANALOG DEVICES INC	334.95	373.27	6,820	1,003,019	半導体・半導体製造装置
ADVANCED MICRO DEVICES	1,013.83	1,218.18	15,087	2,218,868	半導体・半導体製造装置
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	505.66	552.64	3,582	526,917	保険
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	160.97	160.97	1,704	250,729	消費者サービス
AVERY DENNISON CORP	54.54	54.54	1,049	154,295	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	327.59	367.63	2,577	379,120	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	366.97	417.63	3,688	542,407	資本財
AMGEN INC	334.61	405.06	10,798	1,588,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EATON CORP PLC	250.62	294.68	6,653	978,585	資本財
CONSTELLATION BRANDS INC-A	104.39	127.01	3,022	444,475	食品・飲料・タバコ
APPLIED MATERIALS INC	539.08	621.67	9,285	1,365,583	半導体・半導体製造装置
CME GROUP INC	232.52	267.55	5,748	845,364	金融サービス
ECOLAB INC	164.6	195.74	3,692	543,018	素材
EQUIFAX INC	79.22	91.33	1,978	290,935	商業・専門サービス
GILEAD SCIENCES INC	791.25	921.89	6,935	1,019,986	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STATE STREET CORP	240.45	254.74	1,827	268,771	金融サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	912.82	1,111.07	6,623	974,057	金融サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	307.26	392.41	1,428	210,070	ヘルスケア機器・サービス
CAMPBELL SOUP CO	129.45	129.45	514	75,695	食品・飲料・タバコ
CROWN HOLDINGS INC	68.63	94.13	791	116,383	素材
CARDINAL HEALTH INC	180	180	1,895	278,756	ヘルスケア機器・サービス
FEDEX CORP	154.88	180.74	4,589	674,982	運輸
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	248.92	297.75	3,279	482,260	金融サービス
FMC CORP	85.48	85.48	450	66,226	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	156.29	176.59	1,328	195,380	素材
INTEL CORP	2,618.39	3,160.85	14,204	2,089,108	半導体・半導体製造装置
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	260.27	260.27	797	117,283	メディア・娯楽
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	217.67	217.67	1,675	246,433	保険
WOLFSPEED INC	-	84.61	306	45,108	半導体・半導体製造装置
ILLINOIS TOOL WORKS	196.22	232.64	5,602	823,984	資本財
SIRIUS XM HOLDINGS INC	565.5	565.5	265	39,088	メディア・娯楽
ILLUMINA INC	103.27	115.73	1,175	172,876	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	67.76	75.61	1,105	162,540	ソフトウェア・サービス
SNAP-ON INC	31.06	40.41	1,098	161,557	資本財
CARMAX INC	103.66	103.66	654	96,289	一般消費財・サービス流通・小売り
DANAHER CORP	437.14	529.21	11,775	1,731,893	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DUKE ENERGY CORP	496.46	572.37	5,191	763,582	公益事業
TARGET CORP	293.11	343.31	4,508	663,042	生活必需品流通・小売り
JABIL INC	-	98.08	1,130	166,229	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	57.07	69.98	3,842	565,110	商業・専門サービス
CONAGRA BRANDS INC	308.96	397.22	1,113	163,690	食品・飲料・タバコ
CLOROX COMPANY	73.84	91.04	1,295	190,582	家庭用品・パーソナル用品
ENTERGY CORP	126.77	148	1,488	218,947	公益事業
MICROSOFT CORP	4,500.54	5,297.31	200,688	29,515,270	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	118.42	158.99	848	124,840	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	外貨建金額	邦貨換算金額	
CVS HEALTH CORP	821.13	960.86	6,428	945,388	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	842.2	1,011.68	7,978	1,173,340	ヘルスケア機器・サービス
MICRON TECHNOLOGY INC	722.06	812.66	6,232	916,582	半導体・半導体製造装置
BLACKROCK INC	95.88	110.45	8,253	1,213,905	金融サービス
HASBRO INC	74.91	114.07	529	77,892	耐久消費財・アパレル
KEYCORP	627.41	627.41	780	114,787	銀行
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	889.48	1,006.07	7,086	1,042,249	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	27.71	33.84	1,122	165,027	ヘルスケア機器・サービス
CHUBB LTD	269.75	311.61	7,013	1,031,507	保険
ARROW ELECTRONICS INC	41.3	41.3	493	72,632	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALLSTATE CORP	180.7	205.03	2,777	408,553	保険
EBAY INC	355.51	405.34	1,647	242,268	一般消費財・サービス流通・小売り
EASTMAN CHEMICAL CO	70.27	95.17	791	116,438	素材
DISH NETWORK CORP-A	129.37	-	-	-	メディア・娯楽
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	142.45	170.09	2,136	314,190	家庭用品・パーソナル用品
TRIMBLE INC	155.66	207.83	954	140,357	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LENNAR CORP-A	171.26	193.31	2,451	360,607	耐久消費財・アパレル
LEAR CORP	37.36	37.36	503	74,071	自動車・自動車部品
STRYKER CORP	215.14	251.67	7,408	1,089,554	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	418.93	540.86	931	136,975	公益事業
PROGRESSIVE CORP	366.19	434.69	7,085	1,042,056	保険
AIRBNB INC-CLASS A	232.6	313.1	3,960	582,410	消費者サービス
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	-	203.78	434	63,835	生活必需品流通・小売り
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	48.66	48.66	539	79,343	保険
AMPHENOL CORP-CL A	378.96	453.11	4,086	600,949	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARAMARK	132.42	192.32	534	78,574	消費者サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	116.82	181.66	956	140,610	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	87.26	108.02	1,210	178,008	公益事業
AVANTOR INC	373.82	560.39	1,168	171,920	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PACCAR INC	218.97	399.8	3,650	536,889	資本財
BIO-TECHNE CORP	25.51	132.96	839	123,427	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CMS ENERGY CORP	169.96	205.78	1,167	171,748	公益事業
CARLYLE GROUP INC/THE	100.94	167.3	577	84,935	金融サービス
CARRIER GLOBAL CORP	558.22	613.24	3,201	470,877	資本財
CATALENT INC	107.97	160.25	634	93,258	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTERPOINT ENERGY INC	370.91	443.29	1,236	181,827	公益事業
CERIDIAN HCM HOLDING INC	69.79	104.85	724	106,600	商業・専門サービス
CHEWY INC - CLASS A	39.69	131.19	232	34,208	一般消費財・サービス流通・小売り
CHURCH & DWIGHT CO INC	143.3	171.13	1,619	238,241	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	141.79	192.1	1,504	221,242	ソフトウェア・サービス
DEVON ENERGY CORP	401.69	498.97	2,239	329,345	エネルギー
DOVER CORP	89.29	104.36	1,469	216,056	資本財
DROPBOX INC-CLASS A	165.84	165.84	465	68,487	ソフトウェア・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	208.11	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ESSENTIAL UTILITIES INC	139.09	163.29	577	84,941	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	23.77	29.46	1,338	196,872	金融サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	43.71	50.89	1,207	177,552	金融サービス
GARTNER INC	53.57	61.79	2,657	390,869	ソフトウェア・サービス
WW GRAINGER INC	27.97	35.04	2,718	399,738	資本財
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	47.31	-	-	-	ソフトウェア・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	174.62	193.8	3,229	475,017	消費者サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
HUBSPOT INC	25.61	33.18	1,647	242,290	ソフトウェア・サービス
HYATT HOTELS CORP - CL A	—	33.71	383	56,423	消費者サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	234.72	234.72	840	123,548	素材
KELLANOVA	158.43	195.03	1,007	148,176	食品・飲料・タバコ
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	105.34	1,027	151,096	食品・飲料・タバコ
LIBERTY BROADBAND-C	81.96	81.96	675	99,335	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	123.83	—	—	—	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	134.38	—	—	—	メディア・娯楽
LYFT INC-A	187.51	—	—	—	運輸
M & T BANK CORP	110.46	126.29	1,613	237,238	銀行
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	13.69	16.91	1,847	271,682	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONGODB INC	41.5	52.36	2,201	323,817	ソフトウェア・サービス
MOODY'S CORP	105.11	125.18	4,530	666,247	金融サービス
BIOGEN INC	95.74	111.14	2,579	379,310	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	282.26	436.15	2,939	432,270	エネルギー
OTIS WORLDWIDE CORP	253.48	318.38	2,684	394,868	資本財
OWENS CORNING	52.05	75.97	1,019	149,873	資本財
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	987.35	1,287.42	2,554	375,652	ソフトウェア・サービス
PINTEREST INC- CLASS A	383	481.15	1,601	235,498	メディア・娯楽
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	115.2	145.29	1,507	221,690	金融サービス
ROKU INC	60.12	99.45	1,061	156,133	メディア・娯楽
UIPATH INC - CLASS A	—	252.98	502	73,927	ソフトウェア・サービス
HENRY SCHEIN INC	75.59	104.57	697	102,517	ヘルスケア機器・サービス
SEALED AIR CORP	78.95	133.26	441	64,988	素材
SMITH (A. O.) CORP	71.57	106.52	799	117,650	資本財
STEEL DYNAMICS INC	127.13	127.13	1,468	215,931	素材
UNITY SOFTWARE INC	190.66	190.66	578	85,130	ソフトウェア・サービス
CONFLUENT INC-CLASS A	—	159.54	338	49,789	ソフトウェア・サービス
STARBUCKS CORP	734.09	871.25	8,699	1,279,425	消費者サービス
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	289.06	326.08	2,294	337,470	メディア・娯楽
UGI CORP	152.56	—	—	—	公益事業
UBER TECHNOLOGIES INC	962.42	1,381.31	7,790	1,145,761	運輸
WAYFAIR INC- CLASS A	37.56	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
WESTLAKE CORP	21.89	21.89	281	41,455	素材
WESTROCK CO	167.66	167.66	672	98,877	素材
PTC INC	72.95	92.46	1,437	211,436	ソフトウェア・サービス
WILLIAMS COS INC	755.29	920.48	3,354	493,306	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - C	106.72	106.72	451	66,375	不動産管理・開発
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	153.82	246.29	350	51,507	メディア・娯楽
INTUIT INC	171.98	212.12	12,244	1,800,754	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	174.33	174.33	595	87,581	自動車・自動車部品
BEST BUY CO INC	121.32	149.54	1,058	155,665	一般消費財・サービス流通・小売り
BALL CORP	194.1	234.69	1,286	189,215	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	896.31	1,065.96	5,909	869,136	ヘルスケア機器・サービス
VULCAN MATERIALS CO	87.62	98.92	2,103	309,410	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	161.59	193.46	6,790	998,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	205.83	205.83	352	51,854	耐久消費財・アパレル
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	409.64	409.64	590	86,814	メディア・娯楽
MOHAWK INDUSTRIES INC	28.63	28.63	251	36,969	耐久消費財・アパレル
CARNIVAL CORP	697.45	697.45	1,039	152,937	消費者サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	334.03	334.03	564	83,022	素材

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		
COMCAST CORP-CLASS A	2,796.7	3,131.5	13,036	1,917,268	メディア・娯楽	
APTIV PLC	174.16	211.17	1,737	255,504	自動車・自動車部品	
STERIS PLC	62.71	75.25	1,485	218,507	ヘルスケア機器・サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	68.23	78.97	1,901	279,633	保険	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	132.6	158.03	943	138,751	食品・飲料・タバコ	
ATLASSIAN CORP-CL A	—	109.41	2,139	314,658	ソフトウェア・サービス	
LINDE PLC/OLD	320.85	—	—	—	素材	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	207.85	271.62	730	107,457	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FERGUSON PLC	—	160.77	2,711	398,834	資本財	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	76	125.38	405	59,689	資本財	
NXP SEMICONDUCTORS NV	165.94	197.15	4,028	592,451	半導体・半導体製造装置	
AERCAP HOLDINGS NV	87.8	135.05	897	132,041	資本財	
BUNGE GLOBAL SA	—	123.43	1,334	196,232	食品・飲料・タバコ	
SEA LTD-ADR	247.19	281.49	1,034	152,098	メディア・娯楽	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	966.61	1,594.85	491	72,242	運輸	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	116	116	457	67,319	資本財	
TELEFLEX INC	30.67	30.67	678	99,797	ヘルスケア機器・サービス	
WIX.COM LTD	31.94	41.19	420	61,856	ソフトウェア・サービス	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	23	31.73	632	92,985	ソフトウェア・サービス	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	62.49	—	—	—	運輸	
MONDAY.COM LTD	—	18.79	328	48,360	ソフトウェア・サービス	
GLOBAL-E ONLINE LTD	—	88.96	305	44,967	一般消費財・サービス流通・小売り	
ALLEGION PLC	47.64	68.43	715	105,259	資本財	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	253.2	290.61	2,394	352,092	保険	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	143.63	172.25	3,834	563,984	資本財	
NOVOCURE LTD	69.29	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	118	137.15	1,076	158,299	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LIBERTY GLOBAL LTD-C	—	210.79	356	52,360	電気通信サービス	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	40.89	40.89	467	68,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	791	791	252	37,110	不動産管理・開発	
AMCOR PLC	976.1	976.1	926	136,233	素材	
AON PLC-CLASS A	131.51	148.65	4,788	704,173	保険	
INVESCO LTD	183.28	183.28	261	38,491	金融サービス	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	53.75	65.33	356	52,402	金融サービス	
CLARIVATE PLC	199.39	199.39	153	22,579	商業・専門サービス	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	215,606.3 597銘柄	255,249.79 603銘柄	2,954,075 —	434,455,948 <71.5%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
IMPERIAL OIL LTD	162.67	162.67	1,272	137,704	エネルギー	
METRO INC/CN	147.65	189.29	1,309	141,701	生活必需品流通・小売り	
HYDRO ONE LTD	188.21	247.47	929	100,527	公益事業	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	298.36	349.47	1,761	190,593	素材	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	44.38	44.38	449	48,619	素材	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	13.38	14.8	4,759	515,000	ソフトウェア・サービス	
WSP GLOBAL INC	76.68	92.6	1,726	186,807	資本財	
AIR CANADA	120.83	120.83	210	22,815	運輸	
NUTRIEN LTD	340.81	367.92	2,776	300,465	素材	
QUEBECOR INC -CL B	145.78	145.78	433	46,898	電気通信サービス	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	441.54	441.54	364	39,465	公益事業	
LUNDIN MINING CORP	464.46	464.46	432	46,791	素材	
ALTAGAS LTD	173.47	273.09	738	79,906	公益事業	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	—	326.74	702	76,016	金融サービス
STANTEC INC	—	99.39	964	104,334	資本財
TFI INTERNATIONAL INC	50.97	50.97	808	87,535	運輸
TOURMALINE OIL CORP	204.01	261.07	1,705	184,559	エネルギー
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	529.06	579.69	4,418	478,177	生活必需品流通・小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	310.91	342.21	2,281	246,919	素材
ARC RESOURCES LTD	449.23	449.23	973	105,389	エネルギー
BRP INC/CA- SUB VOTING	30.82	30.82	292	31,682	耐久消費財・アパレル
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	—	64.24	705	76,382	ソフトウェア・サービス
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	—	235.55	1,142	123,671	金融サービス
INTACT FINANCIAL CORP	114.16	124.46	2,599	281,329	保険
BCE INC	55.09	55.09	292	31,666	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	127.89	147.24	2,282	246,943	素材
SUNCOR ENERGY INC	932.93	1,007.85	4,518	488,913	エネルギー
NATIONAL BANK OF CANADA	225.33	259.56	2,323	251,434	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	742.87	889	5,308	574,402	銀行
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	589.41	647.92	3,457	374,114	銀行
TORONTO-DOMINION BANK	1,164.32	1,397.36	11,640	1,259,565	銀行
ROYAL BANK OF CANADA	905.61	1,051.93	12,497	1,352,406	銀行
TC ENERGY CORP	618.97	736.52	3,712	401,761	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	1,147.92	1,255.29	2,967	321,113	素材
THOMSON REUTERS CORP	113.7	126.39	2,389	258,598	商業・専門サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	91.48	91.48	335	36,349	生活必需品流通・小売り
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	225.95	284.51	1,633	176,777	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	272.43	364.83	2,648	286,612	素材
KINROSS GOLD CORP	635.01	1,101.56	873	94,525	素材
BANK OF MONTREAL	425.03	536.93	5,911	639,694	銀行
CAMECO CORP	266.27	335.86	2,017	218,351	エネルギー
TELUS CORP	152.22	152.22	363	39,301	電気通信サービス
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	30.01	47.37	665	72,024	一般消費財・サービス流通・小売り
IVANHOE MINES LTD-CL A	326.98	564.32	621	67,293	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	723.31	825.06	7,440	805,124	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	13.93	17.45	2,145	232,133	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	189.21	224.36	1,654	179,001	自動車・自動車部品
WESTON (GEORGE) LTD	49.84	49.84	808	87,461	生活必需品流通・小売り
PAN AMERICAN SILVER CORP	117.63	251.57	535	57,929	素材
BLACKBERRY LTD	486.54	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ENBRIDGE INC	1,275.5	1,551.65	7,280	787,805	エネルギー
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,214.16	1,349.95	3,542	383,308	保険
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	581.52	685.55	6,646	719,207	運輸
GILDAN ACTIVEWEAR INC	113.02	113.02	549	59,461	耐久消費財・アパレル
CGI INC	134.76	157.2	2,154	233,130	ソフトウェア・サービス
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	311.75	—	—	—	メディア・娯楽
IGM FINANCIAL INC	49.49	49.49	165	17,940	金融サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	414.52	414.52	470	50,955	素材
RB GLOBAL INC	79.3	125.2	1,075	116,349	商業・専門サービス
BROOKFIELD CORP	881.4	1,031.4	4,987	539,735	金融サービス
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	63.36	112	404	43,775	公益事業
CAE INC	179.63	274.74	726	78,634	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B	87.05	132.68	745	80,702	素材
CANADIAN NATL RAILWAY CO	364.38	429.42	6,678	722,709	運輸

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末			業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
CANADIAN UTILITIES LTD-A	73.44	73.44	221	23,999	公益事業	
CENOVUS ENERGY INC	856.69	998.24	2,396	259,354	エネルギー	
DOLLARAMA INC	170.25	204.68	1,993	215,725	一般消費財・サービス流通・小売り	
EMERA INC	180	225.91	1,073	116,117	公益事業	
FIRSTSERVICE CORP	25.16	36.69	778	84,275	不動産管理・開発	
FORTIS INC	301.71	350.86	1,907	206,386	公益事業	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	99.13	156.3	583	63,137	商業・専門サービス	
GREAT-WEST LIFECO INC	142	229.64	988	106,976	保険	
IA FINANCIAL CORP INC	82.68	82.68	736	79,716	保険	
KEYERA CORP	113.74	198.02	653	70,690	エネルギー	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	63.63	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
LOBLAW COMPANIES LTD	115.73	115.73	1,394	150,853	生活必需品流通・小売り	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC	50.42	50.42	141	15,331	金融サービス	
NORTHLAND POWER INC	157.41	157.41	344	37,268	公益事業	
ONEX CORPORATION	42.17	42.17	392	42,520	金融サービス	
OPEN TEXT CORP	153.37	215.07	1,189	128,767	ソフトウェア・サービス	
PARKLAND CORP	76.66	76.66	335	36,267	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	373.48	373.48	1,682	182,025	エネルギー	
POWER CORP OF CANADA	317.68	414.36	1,546	167,379	保険	
RESTAURANT BRANDS INTERN	192.7	210.66	1,994	215,850	消費者サービス	
SAPUTO INC	134.25	182.7	475	51,500	食品・飲料・タバコ	
SHOPIFY INC - CLASS A	709.5	889.05	8,865	959,347	ソフトウェア・サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	370.83	419.57	2,869	310,456	保険	
TMX GROUP LTD	31.42	260.34	747	80,851	金融サービス	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	60.27	60.27	666	72,098	資本財	
小計	株数 銘柄数	金額 銘柄数	金額	金額		
	25,581.42 85銘柄	30,351.35 86銘柄	182,214	19,717,414		
	比率				< 3.2% >	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
AURIZON HOLDINGS LTD	1,302.51	1,302.51	462	45,060	運輸	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	658.44	929.6	1,177	114,776	素材	
BHP GROUP LTD	3,236.91	3,768.28	17,405	1,696,184	素材	
REA GROUP LTD	28.33	38.13	604	58,872	メディア・娯楽	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	37.94	-	-	-	消費者サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,287.24	1,937.02	662	64,556	保険	
SOUTH32 LTD	2,763.48	3,366.39	1,030	100,384	素材	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1,194.9	1,413.15	4,380	426,905	エネルギー	
IDP EDUCATION LTD	109.4	158.55	362	35,366	消費者サービス	
WISETECH GLOBAL LTD	106.21	106.21	700	68,311	ソフトウェア・サービス	
XERO LTD	86.83	111.73	1,140	111,145	ソフトウェア・サービス	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	127.22	227.86	763	74,386	金融サービス	
PILBARA MINERALS LTD	-	1,971.6	701	68,399	素材	
FORTESCUE LTD	1,052	1,218.17	3,018	294,165	素材	
COLES GROUP LTD	847.99	999.72	1,519	148,082	生活必需品流通・小売り	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	893.18	1,387.38	678	66,112	生活必需品流通・小売り	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,073.67	2,374.26	6,671	650,154	銀行	
LOTTERY CORP LTD/THE	1,397.85	1,732.68	790	76,995	消費者サービス	
WESTPAC BANKING CORP	2,273.53	2,547.56	5,388	525,069	銀行	
TELSTRA GROUP LTD	2,733.43	2,733.43	1,033	100,688	電気通信サービス	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	-	2,245.17	5,428	529,038	銀行	
SANTOS LTD	2,138.11	2,396.85	1,663	162,099	エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,832.88	-	-	-	銀行	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
RIO TINTO LTD	227.51	293.68	3,658	356,536	素材
ORIGIN ENERGY LTD	1,109.98	1,348.65	1,132	110,397	公益事業
EVOLUTION MINING LTD	844.2	—	—	—	素材
SEEK LTD	219.57	298.33	697	67,970	メディア・娯楽
TREASURY WINE ESTATES LTD	456.84	456.84	485	47,279	食品・飲料・タバコ
NEWCREST MINING LTD	540.82	—	—	—	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,070.36	1,242.66	12,840	1,251,297	銀行
AMPOL LTD	144.28	190.16	649	63,283	エネルギー
ORICA LTD	362.12	362.12	560	54,591	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,018.6	1,244.5	1,887	183,976	保険
WOOLWORTHS GROUP LTD	747.6	882.46	3,025	294,793	生活必需品流通・小売り
QANTAS AIRWAYS LTD	782.26	782.26	406	39,640	運輸
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	261.08	337.23	1,603	156,263	素材
MACQUARIE GROUP LTD	226.04	280.15	4,638	452,043	金融サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	377.19	452.43	1,823	177,679	消費者サービス
CSL LTD	304.42	355.57	9,323	908,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESFARMERS LTD	732.5	830	4,375	426,417	一般消費財・サービス流通・小売り
COCHLEAR LTD	40.95	54.04	1,442	140,607	ヘルスケア機器・サービス
BLUESCOPE STEEL LTD	372.14	372.14	755	73,654	素材
SUNCORP GROUP LTD	882.34	882.34	1,202	117,196	保険
ASX LTD	111.8	153.85	893	87,077	金融サービス
COMPUTERSHARE LTD	287.38	384.85	895	87,308	商業・専門サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,737.55	1,737.55	1,000	97,530	保険
SONIC HEALTHCARE LTD	311.26	311.26	899	87,690	ヘルスケア機器・サービス
BRAMBLES LTD	860.89	1,051.61	1,373	133,838	商業・専門サービス
IGO LTD	—	543.23	463	45,155	素材
MINERAL RESOURCES LTD	116.62	116.62	714	69,585	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	107.81	145.65	713	69,548	ヘルスケア機器・サービス
REECE LTD	130.59	130.59	246	23,975	資本財
小計	株数: 40,566.75 銘柄数: 49銘柄	金額: 48,207.02 銘柄数: 48銘柄	113,295	11,040,629	
	金額比率: < 1.8% >				
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	915	915	3,646	68,695	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,490	1,760	7,084	133,462	消費者サービス
MTR CORP	845	1,185	3,329	62,734	運輸
SUN HUNG KAI PROPERTIES	890	1,080	8,251	155,452	不動産管理・開発
SINO LAND CO	2,482	2,482	1,928	36,333	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	270	270	1,377	25,942	不動産管理・開発
CLP HOLDINGS LTD	941	1,196	7,223	136,097	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	833.84	833.84	1,771	33,382	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS	7,223.89	8,613.89	4,565	86,011	公益事業
HANG SENG BANK LTD	482	634	5,547	104,514	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	848.33	848.33	994	18,731	不動産管理・開発
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,734.24	1,969.24	7,709	145,248	資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,269.24	1,609.24	6,139	115,663	不動産管理・開発
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	738	880	24,604	463,554	金融サービス
WH GROUP LTD	5,610	5,610	2,754	51,894	食品・飲料・タバコ
HANG LUNG PROPERTIES LTD	980	1,900	2,014	37,943	不動産管理・開発
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	940	940	835	15,743	資本財
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	896	1,470	2,002	37,720	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,250	1,250	3,118	58,757	不動産管理・開発

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	
SWIRE PROPERTIES LTD	530	1,168	1,775	33,447	不動産管理・開発
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	410	410	1,562	29,429	公益事業
AIA GROUP LTD	7,632	8,682	60,079	1,131,896	保険
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	700	1,600	1,958	36,896	運輸
SANDS CHINA LTD	1,424	1,728	3,290	61,985	消費者サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,170	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	830	1,010	8,074	152,132	資本財
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,470	2,470	5,199	97,955	銀行
ESR GROUP LTD	1,570	1,570	1,570	29,578	不動産管理・開発
小 計	株 数 銘柄数	47,374.54 28銘柄	54,084.54 27銘柄	178,408 —	3,361,208 < 0.6% >
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	756	935	2,554	281,956	銀行
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,098	1,309	4,157	458,892	銀行
SINGAPORE AIRLINES LTD	779.66	1,135.66	723	79,850	運輸
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,762	2,201	673	74,341	不動産管理・開発
KEPPEL CORP LTD	944	944	606	66,999	資本財
UOL GROUP LTD	309	309	183	20,259	不動産管理・開発
CITY DEVELOPMENTS LTD	258	490	305	33,695	不動産管理・開発
SEATRIUM LTD	—	32,317.27	345	38,168	資本財
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	—	108	313	34,571	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,114	2,584	3,279	361,946	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	3,275	4,525	411	45,451	消費者サービス
VENTURE CORP LTD	217	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,807.15	5,790.15	1,325	146,357	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,086	1,086	403	44,592	資本財
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	—	892	460	50,804	公益事業
SINGAPORE EXCHANGE LTD	652	652	623	68,801	金融サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,300	1,596	587	64,829	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 銘柄数	19,357.81 14銘柄	56,874.08 16銘柄	16,955 —	1,871,520 < 0.3% >
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
SPARK NEW ZEALAND LTD	990.68	1,320.27	669	60,712	電気通信サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	664.54	913.27	468	42,493	公益事業
EBOS GROUP LTD	—	129.72	479	43,520	ヘルスケア機器・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	788.08	909.13	718	65,141	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	390.17	457.32	1,088	98,719	ヘルスケア機器・サービス
MERCURY NZ LTD	625.22	482.06	293	26,583	公益事業
小 計	株 数 銘柄数	3,458.69 5銘柄	4,211.77 6銘柄	3,717 —	337,172 < 0.1% >
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BP PLC	12,227.97	12,846.25	6,062	1,132,651	エネルギー
ASHTREAD GROUP PLC	261.31	304.39	1,440	269,233	資本財
UNILEVER PLC	1,633.79	1,908.22	7,162	1,338,242	家庭用品・パーソナル用品
NMC HEALTH PLC	39.4	39.4	0	7	ヘルスケア機器・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	1,443	2,514.82	395	73,910	一般消費財・サービス流通・小売り
AUTO TRADER GROUP PLC	513.19	779.01	559	104,534	メディア・娯楽
AVEVA GROUP LTD	60.37	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BARCLAYS PLC	10,831.54	12,087.42	1,695	316,855	銀行
SHELL PLC	4,729.35	5,080.42	12,972	2,423,847	エネルギー
WISE PLC - A	—	436.61	341	63,727	金融サービス

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	
HALEON PLC	2,935.73	4,152.31	1,374	256,873	家庭用品・パーソナル用品
ENDEAVOUR MINING PLC	—	175.07	321	59,990	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,941.44	6,491.46	1,709	319,468	資本財
PRUDENTIAL PLC	1,780.81	2,119.66	1,810	338,295	保険
NATWEST GROUP PLC	3,474.2	4,072.38	840	157,046	銀行
JOHNSON MATTHEY PLC	100.74	196.37	315	58,942	素材
BAE SYSTEMS PLC	2,092.6	2,315.22	2,396	447,715	資本財
AVIVA PLC	1,740.6	2,178.35	905	169,150	保険
GSK PLC	2,574.03	3,111.33	4,358	814,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RELX PLC	1,214.21	1,440.62	4,388	819,877	商業・専門サービス
DIAGEO PLC	1,457.4	1,691.99	4,636	866,200	食品・飲料・タバコ
RIO TINTO PLC	726.7	830.83	4,486	838,254	素材
STANDARD CHARTERED PLC	1,518.95	1,823.97	1,168	218,242	銀行
TESCO PLC	4,959.19	5,515.71	1,568	293,089	生活必需品流通・小売り
PEARSON PLC	396.23	469.42	435	81,338	消費者サービス
NEXT PLC	90.3	90.3	716	133,792	一般消費財・サービス流通・小売り
TAYLOR WIMPEY PLC	2,255.88	2,255.88	291	54,414	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC	226.58	226.58	666	124,589	資本財
VODAFONE GROUP PLC	16,395.44	16,293.76	1,153	215,538	電気通信サービス
KINGFISHER PLC	1,096.78	1,795.93	395	73,854	一般消費財・サービス流通・小売り
WPP PLC	785.03	785.03	551	103,112	メディア・娯楽
UNITED UTILITIES GROUP PLC	420.35	512.08	576	107,636	公益事業
SEVERN TRENT PLC	149.04	201.17	546	102,085	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	1,568.48	1,904.67	827	154,660	商業・専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	449.2	535.59	2,886	539,375	家庭用品・パーソナル用品
SSE PLC	705.32	788.38	1,443	269,634	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	647.66	647.66	329	61,496	耐久消費財・アパレル
ASTRAZENECA PLC	980.93	1,150.98	11,546	2,157,372	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,863.91	4,570.83	1,044	195,142	保険
3I GROUP PLC	608.07	705.72	1,574	294,172	金融サービス
SAGE GROUP PLC/THE	750.45	750.45	848	158,441	ソフトウェア・サービス
NATIONAL GRID PLC	2,243.29	2,806.06	2,877	537,653	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	43,247.26	48,018.58	2,084	389,375	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	594.22	594.22	1,090	203,673	食品・飲料・タバコ
CENTRICA PLC	—	4,038.1	595	111,210	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	66.37	66.37	308	57,613	耐久消費財・アパレル
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,385.71	1,577.93	3,967	741,325	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	12,552.33	14,650.67	8,714	1,628,164	銀行
ANGLO AMERICAN PLC	803.77	954.36	2,040	381,321	素材
COMPASS GROUP PLC	1,100.16	1,275.18	2,572	480,559	消費者サービス
PERSIMMON PLC	169.16	276.65	348	65,076	耐久消費財・アパレル
SAINSBURY (J) PLC	1,134.8	1,134.8	321	60,109	生活必需品流通・小売り
BT GROUP PLC	4,039.57	5,406.23	662	123,737	電気通信サービス
BURBERRY GROUP PLC	262.33	262.33	380	71,069	耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC	572.78	572.78	585	109,319	ヘルスケア機器・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	213.45	304.87	2,716	507,530	金融サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	145.9	145.9	251	46,955	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	198.08	535	100,036	保険
ANTOFLAGASTA PLC	194.39	309.83	439	82,115	素材
ABRDN PLC	1,380.15	1,380.15	230	43,115	金融サービス
EXPERIAN PLC	547.49	697.5	2,035	380,276	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			
SCHRODERS PLC		617.11	617.11	247	46,235	金融サービス				
HALMA PLC		243.75	322.77	685	128,090	テクノロジー・ハードウェアおよび機器				
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		242.58	242.58	579	108,232	食品・飲料・タバコ				
ST JAMES' S PLACE PLC		338.23	338.23	218	40,912	金融サービス				
INTERTEK GROUP PLC		118.84	118.84	473	88,460	商業・専門サービス				
MONDI PLC		339.05	339.05	474	88,687	素材				
WHITBREAD PLC		112.82	165.22	513	96,004	消費者サービス				
HARGREAVES LANSDOWN PLC		310.08	310.08	220	41,157	金融サービス				
SMITHS GROUP PLC		243.69	243.69	398	74,511	資本財				
OCADO GROUP PLC		273.79	426.97	253	47,354	生活必需品流通・小売り				
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		592.86	592.86	274	51,364	保険				
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		118.2	118.2	722	135,068	消費者サービス				
CRODA INTERNATIONAL PLC		78.38	102.96	458	85,604	素材				
M&G PLC		1,197.33	1,197.33	251	47,068	金融サービス				
INFORMA PLC		1,027.55	1,027.55	758	141,686	メディア・娯楽				
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		44.59	59.04	541	101,220	資本財				
MELROSE INDUSTRIES PLC		3,052.27	1,194.56	624	116,729	資本財				
GLENCORE PLC		6,227.41	7,736.48	3,434	641,650	素材				
COCA-COLA HBC AG-DI		87.04	178.66	389	72,736	食品・飲料・タバコ				
CRH PLC		—	545.81	2,687	502,043	素材				
DCC PLC		59.54	59.54	319	59,649	資本財				
ENTAIN PLC		421.58	421.58	337	63,030	消費者サービス				
FERGUSON PLC		133.61	—	—	—	資本財				
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比率>	179,294.95	206,825.94	134,366	25,104,983					
(イスラエル)		80銘柄	82銘柄	—	<4.1%>					
TOWER SEMICONDUCTOR LTD		百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	半導体・半導体製造装置				
BANK HAPOALIM BM		74.38	—	—	—	銀行				
BANK LEUMI LE-ISRAEL		846.82	983.27	3,146	125,586	銀行				
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		926.39	1,159.37	3,338	133,270	銀行				
NICE LTD		853.39	853.39	1,581	63,116	銀行				
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		39.19	39.19	2,813	112,278	ソフトウェア・サービス				
AZRIELI GROUP LTD		92.49	119.16	1,625	64,872	銀行				
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		21.4	35.27	781	31,209	不動産管理・開発				
ICL GROUP LTD		1,795.69	—	—	—	電気通信サービス				
ELBIT SYSTEMS LTD		417.73	671.43	1,304	52,070	素材				
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比率>	5,081.37	3,874.97	15,646	624,488					
(スイス)		10銘柄	8銘柄	—	<0.1%>					
AVOLTA AG		百株	百株	千スイス・フラン	千円	一般消費財・サービス流通・小売り				
UBS GROUP AG-REG		—	86.56	267	45,041	金融サービス				
JULIUS BAER GROUP LTD		2,212.55	2,482.48	5,933	1,000,087	金融サービス				
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		151.68	151.68	658	110,961	金融サービス				
HOLCIM LTD		30.3	30.3	594	100,181	資本財				
SWISS PRIME SITE-REG		352.46	394.59	2,521	425,012	素材				
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		55.72	55.72	486	81,993	不動産管理・開発				
ADECCO GROUP AG-REG		0.72	0.72	783	132,043	食品・飲料・タバコ				
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		91.18	148.1	622	104,897	商業・専門サービス				
PARTNERS GROUP HOLDING AG		0.06	0.08	859	144,826	食品・飲料・タバコ				
SCHINDLER HOLDING AG-REG		13.72	15.85	1,813	305,639	金融サービス				
SIKA AG-REG		17.66	17.66	329	55,546	資本財				
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比率>	92.91	110.05	2,605	439,264	素材				

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	
ALCON INC	311.65	359.56	2,352	396,493	ヘルスケア機器・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	30.06	318	53,759	銀行
ROCHE HOLDING AG-BR	17.4	25.84	643	108,541	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	52.25	52.25	229	38,619	耐久消費財・アパレル
BACHEM HOLDING AG	17.56	17.56	115	19,476	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VAT GROUP AG	14.36	21.64	841	141,893	資本財
SIG GROUP AG	222.69	222.69	451	76,049	素材
BKW AG	—	13.85	208	35,228	公益事業
CREDIT SUISSE GROUP AG-RTS	1,681.96	—	—	—	金融サービス
HELVETIA HOLDING AG-REG	—	22.21	262	44,213	保険
SANDOZ GROUP AG	—	309.36	803	135,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	445.08	522.44	12,350	2,081,797	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD-REG	1,037.2	1,194.21	4,071	686,218	資本財
SWISS RE AG	192.28	227.81	2,340	394,556	保険
NESTLE SA-REG	1,789.46	2,000.93	19,835	3,343,424	食品・飲料・タバコ
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,681.96	—	—	—	金融サービス
SGS SA-REG	3.74	114.5	852	143,747	商業・専門サービス
SWATCH GROUP AG/THE-BR	17.16	17.16	394	66,469	耐久消費財・アパレル
BALOISE HOLDING AG - REG	24.75	39.09	507	85,525	保険
CLARIANT AG-REG	101.01	101.01	132	22,253	素材
NOVARTIS AG-REG	1,379.72	1,546.81	13,123	2,212,035	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	327.7	391.72	4,289	723,010	耐久消費財・アパレル
SWISSCOM AG-REG	17.09	19.94	1,019	171,885	電気通信サービス
GIVAUDAN-REG	5.68	6.8	2,206	371,944	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	97.13	111.72	4,865	820,112	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG	70.44	88.23	1,076	181,438	ヘルスケア機器・サービス
SONOVA HOLDING AG-REG	32.69	41.73	1,050	177,116	ヘルスケア機器・サービス
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	104.26	135.55	1,017	171,499	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG-REG	47.15	58.01	1,982	334,217	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEMENOS AG - REG	37.43	37.43	272	46,006	ソフトウェア・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	18.34	22.72	1,274	214,845	保険
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	35.7	41.94	1,074	181,118	運輸
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2.16	2.16	313	52,902	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	3.56	5.38	330	55,726	素材
GEBERIT AG-REG	23.22	23.22	1,129	190,375	資本財
小計	株数 12,831.74	株数 11,319.32	評価額 99,213	評価額 16,723,472	
	銘柄数 42銘柄	銘柄数 45銘柄		< 2.8% >	
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	2.06	2.06	2,206	47,787	運輸
PANDORA A/S	58.88	58.88	5,366	116,234	耐久消費財・アパレル
ORSTED A/S	120.9	149.88	4,736	102,586	公益事業
NOVO NORDISK A/S-B	1,048.8	2,455.7	169,295	3,666,950	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	72.11	72.11	3,855	83,499	素材
DANSKE BANK A/S	391.03	500	8,792	190,445	銀行
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	654.33	784.24	14,315	310,074	資本財
GN STORE NORD A/S	64.84	—	—	—	耐久消費財・アパレル
CARLSBERG AS-B	55.85	80.8	6,685	144,805	食品・飲料・タバコ
NOVOZYMES A/S-B SHARES	140.03	157.85	5,516	119,495	素材
COLOPLAST-B	83.16	83.16	6,679	144,676	ヘルスケア機器・サービス
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	3.11	4.12	4,478	97,003	運輸
TRYG A/S	249.75	249.75	3,645	78,952	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
GENMAB A/S	39.34	46.34	9,926	214,997	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCKWOOL A/S-B SHS	5.13	5.13	936	20,278	資本財
DSV A/S	114.17	137.16	14,449	312,982	運輸
DEMANT A/S	81.78	81.78	2,377	51,493	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,185.27 17銘柄	4,868.96 16銘柄	263,262 -	5,702,262 <0.9%>
(ノルウェー)		百株	百株	千円	
SALMAR ASA	41.88	41.88	2,448	33,811	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	114.12	186.91	3,401	46,978	保険
NORSK HYDRO ASA	877.53	1,081.09	6,817	94,147	素材
AKER BP ASA	212.04	212.04	6,458	89,195	エネルギー
DNB BANK ASA	616.91	668.1	13,682	188,957	銀行
KONGSBERG GRUPPEN ASA	65.26	65.26	3,031	41,871	資本財
ORKLA ASA	469.55	631.95	5,050	69,748	食品・飲料・タバコ
TELENOR ASA	406.94	484.35	5,601	77,356	電気通信サービス
EQUINOR ASA	608.49	722.37	24,723	341,426	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	108.72	127.18	4,602	63,562	素材
MOWI ASA	233.18	307.23	5,906	81,568	食品・飲料・タバコ
ADEVINTA ASA	155.4	155.4	1,731	23,907	メディア・娯楽
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,910.02 12銘柄	4,683.76 12銘柄	83,456 -	1,152,531 <0.2%>
(スウェーデン)		百株	百株	千円	
SWEDBANK AB - A SHARES	576.03	635.38	12,278	174,480	銀行
ERICSSON LM-B SHS	1,833.18	2,210.4	11,622	165,152	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VOLVO AB-B SHS	908.83	1,114.79	27,000	383,673	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	106.42	106.42	3,349	47,589	金融サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	60.81	60.81	3,028	43,041	金融サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B	360.76	454.27	11,965	170,029	家庭用品・パーソナル用品
EPIROC AB-A	447.46	447.46	8,680	123,353	資本財
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	82.23	82.23	1,915	27,214	資本財
KINNEVIK AB - B	124.65	-	-	-	金融サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	72.11	72.11	2,270	32,267	金融サービス
INVESTOR AB-A SHS	274.15	-	-	-	金融サービス
SAGAX AB-B	147.21	147.21	3,522	50,058	不動産管理・開発
LIFCO AB-B SHS	151.49	151.49	3,472	49,339	資本財
HOLMEN AB-B SHARES	70.24	70.24	3,094	43,976	素材
INDUTRADE AB	179.13	179.13	4,125	58,621	資本財
VOLVO CAR AB-B	386.28	386.28	1,328	18,871	自動車・自動車部品
SAAB AB-B	-	69.53	3,807	54,104	資本財
BEIJER REF AB	-	239.18	2,800	39,799	資本財
SKF AB-B SHARES	206.07	317.15	6,200	88,106	資本財
ELECTROLUX AB-B	115.55	-	-	-	耐久消費財・アパレル
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	522.1	522.1	9,138	129,862	一般消費財・サービス流通・小売り
NORDEA BANK ABP	2,100.76	2,481.87	29,013	412,275	銀行
SWEDISH MATCH AB	1,030.37	-	-	-	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	384.24	384.24	3,146	44,717	電気通信サービス
GETINGE AB-B SHS	131.51	131.51	2,970	42,215	ヘルスケア機器・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,083.74	1,293.15	16,397	233,003	銀行
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	976.03	1,135.33	11,267	160,104	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	343.7	522.03	8,321	118,243	素材
SKANSKA AB-B SHS	269.15	269.15	4,527	64,330	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	
SANDVIK AB	701.08	768.66	15,711	223,259	資本財
INVESTOR AB-B SHS	1,117.44	1,315.35	28,345	402,793	金融サービス
ATLAS COPCO AB-A SHS	1,697.3	2,001.21	32,369	459,971	資本財
SECURITAS AB-B SHS	410.1	410.1	3,807	54,102	商業・専門サービス
TELIA CO AB	1,876.75	1,876.75	4,676	66,458	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB	186.97	230.93	9,001	127,913	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	1,074.24	1,250.66	17,340	246,407	資本財
ASSA ABLOY AB-B	624.54	725.39	19,556	277,898	資本財
BOLIDEN AB	152.97	206.58	5,874	83,470	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	185.93	348.97	2,802	39,819	資本財
SWEDISH ORPHAN BIVITRUM AB	135.13	135.13	3,410	48,465	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEXAGON AB-B SHS	1,170.1	1,571.05	16,417	233,292	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	319.38	319.38	2,006	28,510	不動産管理・開発
EQT AB	231.94	231.94	5,770	82,001	金融サービス
EVOLUTION AB	112.54	131.01	14,434	205,116	消費者サービス
VOLVO AB-A SHS	132.83	132.83	3,259	46,319	資本財
EMBRACER GROUP AB	300.12	—	—	—	メディア・娯楽
EPIROC AB-B	198.36	331.82	5,471	77,753	資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	892.71	1,092.74	6,838	97,173	資本財
小 計	株 数 : 24,464.63 銘柄数 <比率> 46銘柄	株 数 : 26,563.96 銘柄数 43銘柄	外 貨 建 金 額 : 392,340 —	邦 貨 換 算 金 額 : 5,575,157 <0.9%>	
(ユーロ・・・アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KINGSPAN GROUP PLC	95.97	112.62	802	129,689	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	171.89	208.28	690	111,514	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC	—	752.42	645	104,194	銀行
AIB GROUP PLC	—	909.21	377	60,911	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	110.19	132.39	1,903	307,370	消費者サービス
KERRY GROUP PLC-A	98.94	124.02	915	147,784	食品・飲料・タバコ
CRH PLC	459.64	—	—	—	素材
小 計	株 数 : 936.63 銘柄数 <比率> 5銘柄	株 数 : 2,238.94 銘柄数 6銘柄	外 貨 建 金 額 : 5,333 —	邦 貨 換 算 金 額 : 861,465 <0.1%>	
(ユーロ・・・オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	527.27	680.92	1,282	207,061	ヘルスケア機器・サービス
AIRBUS SE	381.7	438.24	5,940	959,495	資本財
HEINEKEN HOLDING NV	61.68	79.62	561	90,723	食品・飲料・タバコ
NN GROUP NV	169.17	169.17	537	86,749	保険
QIAGEN N.V.	156.65	156.65	589	95,205	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	287.87	287.87	360	58,233	銀行
STELLANTIS NV	1,392.38	1,717.48	3,385	546,847	自動車・自動車部品
FERRARI NV	79.86	89.92	3,015	487,100	自動車・自動車部品
ADYEN NV	13.94	15.53	1,689	272,847	金融サービス
PROSUS NV	510.27	1,145.57	3,445	556,450	一般消費財・サービス流通・小売り
CNH INDUSTRIAL NV	687.66	820.28	794	128,376	資本財
ASM INTERNATIONAL NV	31.7	31.7	1,487	240,326	半導体・半導体製造装置
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	444.22	661.7	1,600	258,521	メディア・娯楽
OCI NV	60	60	125	20,301	素材
EXOR NV	62.04	86.69	766	123,771	金融サービス
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	—	62.86	808	130,510	半導体・半導体製造装置
FERROVIAL SE	—	388.69	1,225	197,999	資本財
ASR NEDERLAND NV	—	145.93	546	88,195	保険
HEINEKEN NV	160.91	228.05	1,886	304,677	食品・飲料・タバコ

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	646.61	710.69	1,871	302,339	生活必需品流通・小売り	
AKZO NOBEL N.V.	124.75	124.75	875	141,401	素材	
DSM BV	104.33	—	—	—	素材	
WOLTERS KLUWER	163.6	188.02	2,368	382,473	商業・専門サービス	
ING GROEP NV	2,541.05	2,706.46	3,455	558,115	銀行	
KONINKLIJKE KPN NV	2,221.79	2,221.79	704	113,752	電気通信サービス	
ASML HOLDING NV	257.52	302.12	19,009	3,070,206	半導体・半導体製造装置	
RANDSTAD NV	89.46	89.46	490	79,294	商業・専門サービス	
JDE PEET'S NV	66.6	133.17	325	52,523	食品・飲料・タバコ	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	354.07	354.07	351	56,819	食品・飲料・タバコ	
EURONEXT NV	55.02	55.02	418	67,624	金融サービス	
IMCD NV	32.14	43.4	596	96,310	資本財	
ARGENX SE	35.03	41.59	1,672	270,165	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JUST EAT TAKEAWAY	129.03	—	—	—	消費者サービス	
STMICROELECTRONICS NV	435.38	486.63	2,094	338,236	半導体・半導体製造装置	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	12,283.7 31銘柄	14,724.04 32銘柄	64,284 —	10,382,660 <1.7%>
(ユーロ・・・ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SOFINA	8.04	8.04	162	26,308	金融サービス	
LOTUS BAKERIES	—	0.31	247	39,954	食品・飲料・タバコ	
UCB SA	77.82	102.3	688	111,196	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KBC GROUP NV	149.1	176.43	925	149,542	銀行	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	59.14	79.33	573	92,635	金融サービス	
SOLVAY SA	48.02	48.02	506	81,783	素材	
UMICORE	131.6	169.12	413	66,729	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	566.32	661.43	3,782	610,839	食品・飲料・タバコ	
AGEAS	112.47	112.47	443	71,588	保険	
D'IETIEN GROUP	14.49	18.85	295	47,798	一般消費財・サービス流通・小売り	
PROXIMUS	108.95	—	—	—	電気通信サービス	
ELIA GROUP SA/NV	21.11	21.11	207	33,583	公益事業	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	1,297.06 11銘柄	1,397.41 11銘柄	8,246 —	1,331,960 <0.2%>
(ユーロ・・・ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ARCELORMITTAL	370.54	336.06	767	123,914	素材	
TENARIS SA	259.63	412.01	631	102,044	エネルギー	
EUROFINS SCIENTIFIC	92.7	92.7	489	79,081	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AROUNDTOWN SA	735.08	—	—	—	不動産管理・開発	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	1,457.95 4銘柄	840.77 3銘柄	1,888 —	305,041 <0.1%>
(ユーロ・・・フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BUREAU VERITAS SA	178.17	178.17	400	64,660	商業・専門サービス	
ORANGE	1,277.98	1,327.22	1,494	241,325	電気通信サービス	
GETLINK SE	304.28	304.28	509	82,292	運輸	
DASSAULT AVIATION SA	17.2	17.2	318	51,392	資本財	
TOTALENERGIES SE	1,581.13	1,694.57	10,452	1,688,119	エネルギー	
TELEPERFORMANCE	34.2	42.99	560	90,471	商業・専門サービス	
WORLDFINE SA	166.77	166.77	232	37,574	金融サービス	
ESSILORLUXOTTICA	178.07	219.58	3,891	628,570	ヘルスケア機器・サービス	
AMUNDI SA	39.55	39.55	221	35,835	金融サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	15.55	22.07	457	73,963	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MICHELIN (CGDE)	456.59	518.44	1,598	258,233	自動車・自動車部品	

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		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
AIR LIQUIDE SA	334.12	399.11	6,934	1,120,061	素材
KERING	47.59	58.01	2,268	366,335	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE	348.68	414.72	6,934	1,119,929	資本財
BOUYGUES SA	171.23	171.23	601	97,180	資本財
BNP PARIBAS	720.2	804.74	4,580	739,809	銀行
THALES SA	70.74	70.74	980	158,410	資本財
DANONE	407.11	503.15	2,976	480,675	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	359.9	499.14	866	139,909	生活必需品流通・小売り
VIVENDI SE	384.96	571.61	500	80,817	メディア・娯楽
L'OREAL	151.95	177.38	7,660	1,237,191	家庭用品・パーソナル用品
LEGRAND SA	168.52	195.39	1,722	278,210	資本財
PERNOD RICARD SA	137.33	147.36	2,295	370,686	食品・飲料・タバコ
SOCIETE GENERALE SA	485.58	551.96	1,255	202,720	銀行
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	177	205.1	14,162	2,287,329	耐久消費財・アパレル
ACCOR SA	104.51	164.69	520	84,132	消費者サービス
CAPGEMINI SE	104.53	127.5	2,404	388,272	ソフトウェア・サービス
VALEO	144.44	144.44	195	31,575	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	133.01	155.58	1,202	194,187	メディア・娯楽
SODEXO SA	47.6	69.6	691	111,669	消費者サービス
SEB SA	11.27	11.27	117	19,039	耐久消費財・アパレル
AXA SA	1,195.47	1,325.35	3,769	608,778	保険
EDENRED	146.5	202.97	1,015	163,973	金融サービス
RENAULT SA	147.64	147.64	528	85,425	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	19.73	24.02	4,556	735,935	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SE	400.49	507.81	2,189	353,695	ソフトウェア・サービス
ALSTOM	176.65	255.74	293	47,479	資本財
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	294.71	344.54	2,047	330,652	資本財
SANOFI	730.53	862.55	7,320	1,182,327	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VINCI SA	340.5	387.5	4,344	701,704	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	421.62	487.32	1,397	225,731	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	731.02	908.99	1,072	173,236	銀行
ENGIE	1,178.99	1,422.33	2,257	364,612	公益事業
UBISOFT ENTERTAINMENT	47.45	—	—	—	メディア・娯楽
EDF	326.58	—	—	—	公益事業
SAFRAN SA	217.82	259.61	4,157	671,460	資本財
ARKEMA	32.5	51.45	481	77,712	素材
IPSEN	14.98	33.8	347	56,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOLLORE SE	692.88	692.88	369	59,758	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	12.73	20.08	217	35,204	食品・飲料・タバコ
EURAZEO SE	17.92	17.92	112	18,161	金融サービス
WENDEL	10.82	25.47	199	32,292	金融サービス
EIFFAGE	49.89	66.41	616	99,493	資本財
ADP	13.46	13.46	152	24,565	運輸
BIOMERIEUX	27.91	27.91	275	44,554	ヘルスケア機器・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	57.85	57.85	191	30,945	消費者サービス
小計	株数	金額	株数	金額	
	16,066.4	18,117.16	18,117.16	18,884.459	
	56銘柄	54銘柄	—	< 3.1% >	
(ユーロ・・・ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	796.54	796.54	187	30,232	電気通信サービス
BAYER AG-REG	637.81	758.08	2,325	375,515	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	87.14	546	88,243	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		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
HEIDELBERG MATERIALS AG	86.77	100.08	741	119,774	素材
EVONIK INDUSTRIES AG	176.69	176.69	307	49,683	素材
VONOVIA SE	463.39	523.13	1,357	219,253	不動産管理・開発
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	100.89	100.89	456	73,668	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	36.79	36.79	320	51,843	自動車・自動車部品
KION GROUP AG	31.79	—	—	—	資本財
ZALANDO SE	123.67	174.18	384	62,115	一般消費財・サービス流通・小売り
BECHTLE AG	43.05	43.05	197	31,823	ソフトウェア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	52.69	—	—	—	電気通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,272.33	1,460.2	1,645	265,835	金融サービス
COVESTRO AG	117.97	160.49	779	125,974	素材
MTU AERO ENGINES AG	38.54	38.54	723	116,929	資本財
UNIPER SE	46.97	—	—	—	公益事業
COMMERZBANK AG	606.4	735.61	831	134,312	銀行
VOLKSWAGEN AG	19.6	19.6	234	37,813	自動車・自動車部品
SARTORIUS AG-VORZUG	16.82	21.64	637	102,929	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	118.44	152.75	1,632	263,679	自動車・自動車部品
LEG IMMOBILIEN SE	45.38	65.05	467	75,539	不動産管理・開発
NEMETSCHKE SE	30.11	59.41	481	77,760	ソフトウェア・サービス
RATIONAL AG	3.5	3.5	206	33,351	資本財
SYMRISE AG	84.04	97.21	985	159,201	素材
DELIVERY HERO SE	85.3	132.93	404	65,321	消費者サービス
SIEMENS ENERGY AG	318.78	409.28	440	71,159	資本財
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	293.58	350.66	1,046	168,942	資本財
RHEINMETALL AG	28.99	28.99	797	128,853	資本財
DR ING HC F PORSCHE AG	70	84.98	721	116,498	自動車・自動車部品
TALANX AG	—	53.45	351	56,716	保険
SIEMENS AG-REG	488.9	568.06	8,684	1,402,633	資本財
E.ON SE	1,473.18	1,643.22	1,967	317,812	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	203.47	233.1	2,239	361,684	自動車・自動車部品
GEA GROUP AG	81.78	104.67	352	56,970	資本財
CONTINENTAL AG	80.78	80.78	578	93,414	自動車・自動車部品
BASF SE	590.53	643.23	2,764	446,459	素材
ALLIANZ SE-REG	263.07	295.98	6,837	1,104,266	保険
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	103.98	130.09	928	149,975	家庭用品・パーソナル用品
RWE AG	386.04	482.89	1,895	306,194	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	331.48	508.85	408	65,911	運輸
BRENNTAG SE	99.2	121.53	938	151,648	資本財
FRESENIUS SE & CO KGAA	232.54	312.27	892	144,092	ヘルスケア機器・サービス
SAP SE	669.88	788.9	11,402	1,841,659	ソフトウェア・サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	90.23	106.09	4,110	663,965	保険
BEIERSDORF AG	68.13	68.13	879	142,112	家庭用品・パーソナル用品
MERCK KGAA	77.77	89.96	1,442	233,052	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADIDAS AG	103.95	120.9	2,329	376,315	耐久消費財・アパレル
PUMA SE	64.59	96.01	561	90,682	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,082.85	2,456.84	5,389	870,390	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	136.13	171.25	638	103,111	ヘルスケア機器・サービス
MERCEDES-BENZ GROUP AG	522.42	617.62	3,661	591,428	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	796.41	971.2	3,467	559,984	半導体・半導体製造装置
HANNOVER RUECK SE	35.98	42.98	934	150,981	保険
DHL GROUP	621.78	730.67	3,135	506,383	運輸

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
DEUTSCHE BOERSE AG	119.16	144.32	2,511	405,695	金融サービス
WACKER CHEMIE AG	—	14.14	159	25,783	素材
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	21.61	35.83	300	48,598	ヘルスケア機器・サービス
KNORR-BREMSE AG	38.81	72.17	417	67,442	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	164.26	192.03	1,006	162,579	ヘルスケア機器・サービス
SCOUT24 SE	46.71	46.71	295	47,769	メディア・娯楽
HELLOFRESH SE	97.9	97.9	141	22,800	生活必需品流通・小売り
小計	株数 銘柄数	15,900.09 59銘柄	18,659.18 58銘柄	90,488 —	14,614,776 < 2.4% >
(ユーロ・・・ポルトガル)		百株	百株	千ユーロ	千円
GALP ENERGIA SGPS SA	259.2	316.7	431	69,666	エネルギー
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,952.32	2,270.46	999	161,495	公益事業
JERONIMO MARTINS	173.93	221.06	497	80,404	生活必需品流通・小売り
小計	株数 銘柄数	2,385.45 3銘柄	2,808.22 3銘柄	1,929 —	311,566 < 0.1% >
(ユーロ・・・スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円
TELEFONICA SA	3,359.1	4,122.02	1,602	258,842	電気通信サービス
FERROVIAL SA	321.77	—	—	—	資本財
AENA SME SA	43.77	56.4	882	142,558	運輸
EDP RENOVAVEIS SA	177.64	272.94	446	72,052	公益事業
CAIXABANK SA	2,907.77	3,080.48	1,292	208,812	銀行
CELLNEX TELECOM SA	328.3	411.67	1,444	233,375	電気通信サービス
ENDESA SA	141.04	255.35	487	78,771	公益事業
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	—	68.49	183	29,579	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA	4,202.32	4,525.95	3,935	635,665	銀行
IBERDROLA SA	3,768.63	4,498.51	5,085	821,369	公益事業
REPSOL SA	964.57	964.57	1,352	218,492	エネルギー
GRIFOLS SA	151.69	151.69	192	31,016	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANCO SANTANDER SA	10,464.74	12,299.19	4,671	754,450	銀行
AMADEUS IT GROUP SA	299.28	329.15	2,100	339,273	消費者サービス
NATURGY ENERGY GROUP SA	106.03	106.03	288	46,579	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	131.89	140.86	517	83,630	資本財
ACCIONA SA	18.1	18.1	233	37,652	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	713.41	817.48	3,068	495,645	一般消費財・サービス流通・小売り
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	197.73	—	—	—	資本財
ENAGAS SA	144.71	144.71	242	39,136	公益事業
REDEIA CORP SA	236.32	345.39	529	85,516	公益事業
小計	株数 銘柄数	28,678.81 20銘柄	32,608.98 19銘柄	28,558 —	4,612,422 < 0.8% >
(ユーロ・・・イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円
MONCLER SPA	122.09	157.1	801	129,454	耐久消費財・アパレル
PRYSMIAN SPA	171.86	196.81	694	112,111	資本財
DIASORIN SPA	13.13	13.13	113	18,271	ヘルスケア機器・サービス
POSTE ITALIANE SPA	347.2	347.2	340	55,033	保険
FINECOBANK SPA	430.93	430.93	527	85,154	銀行
ASSICURAZIONI GENERALI	723.82	723.82	1,373	221,767	保険
MEDIOBANCA SPA	477.08	477.08	511	82,678	銀行
UNICREDIT SPA	1,279.61	1,415.13	3,583	578,822	銀行
INTESA SANPAOLO	10,118.86	11,630	3,077	497,014	銀行
MUNDYS SPA	265.01	—	—	—	運輸
ENI SPA	1,601.58	1,671.2	2,524	407,788	エネルギー

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ENEL SPA	5,010.6	6,179.4	3,975	642,035	公益事業
SNAM SPA	1,338.67	1,338.67	610	98,569	公益事業
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	1,016.86	1,016.86	753	121,663	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	6,963.55	6,963.55	183	29,579	電気通信サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	80.68	80.68	357	57,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPLIFON SPA	75.67	101.23	285	46,171	ヘルスケア機器・サービス
NEXI SPA	308.53	570.6	405	65,450	金融サービス
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	158.04	281.9	318	51,448	電気通信サービス
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	外貨建金額 —	邦貨換算金額 3,300,766	
	・ 比率	・ 比率	・ 比率	・ 比率	
(ユーロ・・・フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
WARTSILA OYJ ABP	267.53	382.6	485	78,478	資本財
NESTE OYJ	265.63	315.09	1,077	174,044	エネルギー
UPM-KYMMENE OYJ	328.18	384.47	1,230	198,706	素材
NOKIA OYJ	3,486.1	4,049.25	1,314	212,351	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	392.28	392.28	470	75,933	素材
ELISA OYJ	101.6	101.6	418	67,672	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS	298.43	364.23	1,431	231,277	保険
FORTUM OYJ	243.12	305	395	63,841	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	202.5	202.5	354	57,186	生活必需品流通・小売り
KONE OYJ-B	206.23	242.25	987	159,476	資本財
ORION OYJ-CLASS B	62.61	105.42	384	62,146	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METSO CORP	—	504.83	459	74,213	資本財
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	外貨建金額 9,010	邦貨換算金額 1,455,328	
	・ 比率	・ 比率	・ 比率	・ 比率	
(ユーロ・・・オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	83.89	100.43	395	63,859	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	205.06	251.05	922	148,929	銀行
VOESTALPINE AG	73.82	104.1	271	43,781	素材
VERBUND AG	53.46	53.38	452	73,023	公益事業
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	外貨建金額 2,040	邦貨換算金額 329,594	
	・ 比率	・ 比率	・ 比率	・ 比率	
(ユーロ・・・その他)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AEGON LTD	1,277.48	1,277.48	631	101,966	保険
DSM-FIRMENICH AG	—	139.15	1,212	195,906	素材
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	外貨建金額 1,844	邦貨換算金額 297,873	
	・ 比率	・ 比率	・ 比率	・ 比率	
ユーロ通貨計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	外貨建金額 —	邦貨換算金額 56,687,914	
	・ 比率	・ 比率	・ 比率	・ 比率	
合計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	外貨建金額 —	邦貨換算金額 582,354,704	
	・ 比率	・ 比率	・ 比率	・ 比率	

※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。

外国株式インデックス・マザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首 (前期末)		期		末	組入比率
	口数	口数	評価額		組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカ・ドル	千円	%	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,096	10,245	1,750	257,395	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	20,565	24,260	2,978	437,997	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	9,604	9,604	547	80,510	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	8,706	—	—	—	—	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843	22,843	345	50,829	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	7,141	8,176	2,004	294,839	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	22,609	26,128	1,478	217,416	0.0	
EQUINIX INC	5,902	6,935	5,605	824,419	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	28,877	34,996	7,215	1,061,179	0.2	
SUN COMMUNITIES INC	7,129	10,118	1,295	190,470	0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613	17,613	808	118,844	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	46,189	59,277	1,033	152,039	0.0	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,093	26,290	940	138,380	0.0	
REALTY INCOME CORP	36,686	49,884	2,677	393,746	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,866	9,567	1,184	174,273	0.0	
INVITATION HOMES INC	36,871	44,730	1,474	216,825	0.0	
VICI PROPERTIES INC	60,354	76,652	2,270	333,912	0.1	
KIMCO REALTY CORP	35,169	44,824	852	125,384	0.0	
VENTAS INC	23,363	28,342	1,287	189,280	0.0	
WEYERHAEUSER CO	47,220	54,126	1,715	252,341	0.0	
CROWN CASTLE INC	27,033	33,131	3,842	565,121	0.1	
IRON MOUNTAIN INC	19,659	23,774	1,504	221,254	0.0	
PROLOGIS INC	59,103	69,206	7,823	1,150,535	0.2	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,773	13,343	1,454	213,916	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	6,009	7,861	705	103,761	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,379	4,379	929	136,680	0.0	
WELLTOWER INC	27,308	37,522	3,309	486,719	0.1	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,377	36,377	623	91,698	0.0	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,186	14,256	999	146,952	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	22,502	35,166	636	93,610	0.0	
PUBLIC STORAGE	10,308	11,880	3,063	450,600	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	9,608	13,101	805	118,438	0.0	
UDR INC	20,610	20,610	686	100,905	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	18,137	22,476	3,106	456,826	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			
	口 数	口 数	評 価 額		組 入 比 率	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
EXTRA SPACE STORAGE INC	8,530	15,328	1,985	291,998	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858	—	—	—	—	
WP CAREY INC	11,067	16,778	1,043	153,456	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	807,343 37銘柄	939,798 35銘柄	69,984 <1.7%>	10,292,566 <1.7%>	1.7
(カナダ)	口	口	千カナダ・ドル	千円		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170	8,170	374	40,508	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441	7,441	129	14,034	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	15,611 2銘柄	15,611 2銘柄	504 <0.0%>	54,542 <0.0%>	0.0
(オーストラリア)	口	口	千オーストラリア・ドル	千円		
SCENTRE GROUP	350,311	350,311	921	89,782	0.0	
LENLEASE GROUP	36,263	63,652	424	41,373	0.0	
DEXUS/AU	79,604	79,604	557	54,301	0.0	
TRANSURBAN GROUP	190,071	235,928	3,026	294,976	0.0	
APA GROUP	75,718	89,811	756	73,692	0.0	
GPT GROUP	121,221	121,221	494	48,196	0.0	
MIRVAC GROUP	251,619	326,863	643	62,750	0.0	
STOCKLAND	127,393	193,824	788	76,874	0.0	
GOODMAN GROUP	106,251	133,948	3,123	304,401	0.1	
VICINITY CENTRES	241,241	241,241	437	42,668	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,579,692 10銘柄	1,836,403 10銘柄	11,175 <0.2%>	1,089,018 <0.2%>	0.2
(香港)	口	口	千香港・ドル	千円		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000	276,000	2,318	43,678	0.0	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	193,500	—	—	—	—	
LINK REIT	136,600	189,400	7,367	138,806	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	606,100 3銘柄	465,400 2銘柄	9,686 <0.0%>	182,485 <0.0%>	0.0
(シンガポール)	口	口	千シンガポール・ドル	千円		
CAPITALAND ASCENDAS REIT	219,000	267,000	758	83,698	0.0	
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	303,516	408,716	756	83,461	0.0	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100	208,100	337	37,211	0.0	
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400	112,400	153	16,997	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	843,016 4銘柄	996,216 4銘柄	2,005 <0.0%>	221,368 <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		組 入 比 率	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(イギリス)	口	口	千イギリス・ポンド	千円		
LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861	59,857	376	70,300	0.0	
SEGRO PLC	78,831	89,254	732	136,811	0.0	
BRITISH LAND CO PLC	49,008	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	167,700	149,111	1,108	207,112	0.0
	銘 柄 数 <比 率>	3銘柄	2銘柄		<0.0%>	
(ユーロ・・・ベルギー)	口	口	千ユーロ	千円		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,913	13,418	342	55,305	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	9,913	13,418	342	55,305	0.0
	銘 柄 数 <比 率>	1銘柄	1銘柄		<0.0%>	
(ユーロ・・・フランス)	口	口	千ユーロ	千円		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024	8,942	512	82,696	0.0	
GECINA SA	3,082	3,082	311	50,374	0.0	
KLEPIERRE	13,600	18,172	419	67,797	0.0	
COVIVIO	2,388	2,388	105	17,109	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	26,094	32,584	1,349	217,977	0.0
	銘 柄 数 <比 率>	4銘柄	4銘柄		<0.0%>	
ユーロ通貨計	口 数 ・ 金 額	36,007	46,002	1,692	273,282	0.0
	銘 柄 数 <比 率>	5銘柄	5銘柄		<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	4,055,469	4,448,541	—	12,320,377	2.0
	銘 柄 数 <比 率>	64銘柄	60銘柄		<2.0%>	

※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。

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	期 末	
	買 建 額	売 建 額
外	百万円	百万円
S & P 500 EMINI FUT	9,521	—
S P I 200 FUTURE S	378	—
国		
F T S E 100 I D X F U T	528	—
E U R O S T O X X 50	1,803	—

※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

(2023年11月30日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	582,354,704	95.7
投 資 証 券	12,320,377	2.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	14,153,283	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	608,828,365	100.0

※期末における外貨建資産（606,073,278千円）の投資信託財産総額（608,828,365千円）に対する比率は99.5%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=147.07円、1カナダ・ドル=108.21円、1オーストラリア・ドル=97.45円、1香港・ドル=18.84円、1シンガポール・ドル=110.38円、1ニュージーランド・ドル=90.70円、1イギリス・ポンド=186.84円、1イスラエル・シェケル=39.913円、1スイス・フラン=168.56円、1デンマーク・クローネ=21.66円、1ノルウェー・クローネ=13.81円、1スウェーデン・クローナ=14.21円、1ユーロ=161.51円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	610,174,345,116円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	9,492,589,278
株 式(評価額)	582,354,704,334
投 資 証 券(評価額)	12,320,377,867
未 収 入 金	1,875,388,867
未 収 配 当 金	803,404,260
差 入 委 託 証 拠 金	3,327,880,510
(B) 負 債	2,793,778,064
未 払 金	1,674,961,354
未 払 解 約 金	1,118,815,080
そ の 他 未 払 費 用	1,630
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	607,380,567,052
元 本	81,052,032,606
次 期 繰 越 損 益 金	526,328,534,446
(D) 受 益 権 総 口 数	81,052,032,606口
1万口当たり基準価額(C/D)	74,937円

※当期における期首元本額72,186,242,919円、期中追加設定元本額18,357,964,761円、期中一部解約元本額9,492,175,074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2022年12月1日 至2023年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	10,150,906,831円
受 取 配 当 金	10,013,863,956
受 取 利 息	69,313,021
そ の 他 収 益 金	68,251,024
支 払 利 息	△ 521,170
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	94,389,927,144
売 買 益	126,809,356,624
売 買 損	△ 32,419,429,480
(C) 先 物 取 引 等 損 益	2,548,514,080
取 引 益	3,602,791,451
取 引 損	△ 1,054,277,371
(D) そ の 他 費 用 等	△ 170,689,072
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	106,918,658,983
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	370,015,318,533
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 53,055,617,435
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	102,450,174,365
(I) 合 計(E+F+G+H)	526,328,534,446
次 期 繰 越 損 益 金(I)	526,328,534,446

※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	40,993,532,445円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1 (保守型)	141,347円
三井住友・DC年金バランス30 (債券重点型)	284,367,476円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)	2,079,027円
三井住友・DC年金バランス50 (標準型)	1,101,912,635円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3 (安定成長型)	9,297,239円
三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)	824,925,641円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)	5,432,744円
SMAM・グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	31,803,096円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)	2,398,858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)	809,182円	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	334,360,590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)	4,287,286円	バランスファンドVA (安定運用型) <適格機関投資家限定>	2,083,168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)	13,864,389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>	12,733,609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)	44,327,375円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	352,745,446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)	53,201,554円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	563,666,379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)	112,627,999円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	2,492,534,646円
外国株式指数ファンド	1,023,969,577円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	8,325,935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	21,741,516,631円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	40,662,080円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	31,711,655円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	372,277,079円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	78,665,753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>	29,673,252円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	47,802,122円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	72,529,431円
イオン・バランス戦略ファンド	16,682,579円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	356,314,546円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	25,577,368円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	228,424,293円
三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型)	144,439,096円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	523,702,536円
三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型)	132,408,735円	SMAM・バランスVA40T <適格機関投資家限定>	179,149円
三井住友・資産最適化ファンド (3 バランス型)	516,674,455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)	183,290,958円
三井住友・資産最適化ファンド (4 やや成長型)	304,111,742円	SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	45,029,147円
三井住友・資産最適化ファンド (5 成長重視型)	415,113,239円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	5,291,801円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	62,415,696円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	5,839,402円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	2,365,310,413円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	3,468,121円
三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型)	10,909,978円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	12,153,717円
三井住友DS・年金バランス50 (標準型)	55,882,152円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	41,025,891円
三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型)	52,967,585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>	88,244,496円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,054,592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>	35,686,410円
SMBC・DCインデックスファンド (MSC I コクサイ)	1,040,268,126円	SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	148,918,344円
日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジあり)	216,434,937円	SMAM・世界バランスファンドVA2 <適格機関投資家限定>	52,597,055円
日興FWS・先進国株インデックス (為替ヘッジなし)	2,404,003,330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>	667,223,190円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	110,398,522円	SMAM・年金Wリスクリコントロールファンド <適格機関投資家限定>	24,515,733円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	309,886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>	15,507,627円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	227,339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>	24,710,830円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	209,701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>	12,302,074円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	69,177円	三井住友・ニュー・アジア・ファンド (リスク3%) <適格機関投資家限定>	9,755,415円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	117,577円		

■ お知らせ

<約款変更について>

・信託金限度額を5,000億円から1兆円へ引き上げる信託約款の変更を行いました。

(適用日：2023年3月3日)

エマージング株式インデックス・マザーファンド

第13期（2022年12月1日から2023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。 ・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 (配当込み、 円換算ベース)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額 総
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率				
9 期 (2019年12月2日)	円	%	%	%	%	%	%	百万円
10期 (2020年11月30日)	13,315	2.2	148.27	3.8	48.2	45.1	6.8	8,381
11期 (2021年11月30日)	15,253	14.6	170.44	15.0	61.5	30.4	8.3	11,054
12期 (2022年11月30日)	16,743	9.8	189.30	11.1	56.5	34.1	10.1	17,548
12期 (2022年11月30日)	16,483	△ 1.6	186.80	△ 1.3	69.9	19.9	10.7	26,550
13期 (2023年11月30日)	18,385	11.5	210.35	12.6	81.3	7.2	11.5	37,055

※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エマージング・ マーケット・インデックス (配当込み、 円換算ベース)		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 比
	円	騰 落 率 %	円	騰 落 率 %			
(期 首) 2022年11月30日	16,483	—	186.80	—	69.9	19.9	10.7
12月末	15,831	△ 4.0	179.87	△ 3.7	76.9	11.5	11.7
2023年1月末	16,937	2.8	192.93	3.3	74.1	15.0	10.9
2月末	16,437	△ 0.3	186.89	0.1	71.6	17.6	10.8
3月末	16,467	△ 0.1	187.20	0.2	79.8	8.4	12.0
4月末	16,323	△ 1.0	185.68	△ 0.6	78.0	9.9	12.3
5月末	17,018	3.2	193.77	3.7	78.4	10.1	11.9
6月末	18,055	9.5	205.65	10.1	78.0	10.3	11.6
7月末	18,660	13.2	212.45	13.7	76.2	12.4	11.3
8月末	18,347	11.3	209.25	12.0	74.5	14.4	11.1
9月末	17,950	8.9	205.00	9.7	79.6	8.6	11.9
10月末	17,517	6.3	200.23	7.2	81.3	6.9	11.8
(期 末) 2023年11月30日	18,385	11.5	210.35	12.6	81.3	7.2	11.5

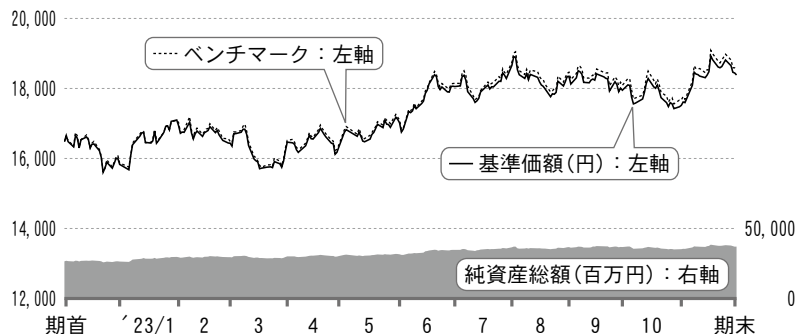
※騰落率は期首比です。

※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（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

基準価額等の推移



期首	16,483円
期末	18,385円
騰落率	+11.5%

※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、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）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（2022年12月1日から2023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、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ・米国の利上げ圧力の緩和や金融不安が後退したことなどから、新興国株式市場の一部が上昇したこと ・期を通じて日本円が米ドルや投資対象市場の通貨に対して下落したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・欧米の金融不安により、新興国株式市場にも売り圧力が波及したこと ・世界的な長期金利（10年国債利回り）の上昇を受けて、韓国などの株式市場が下落したこと

▶ 投資環境について（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

新興国株式市場は上昇しました。投資対象市場の通貨は円に対して上昇しました。

新興国株式市場

期を通じて、欧米の金融不安や各国のインフレ動向、金融政策の変更に対する市場の期待が指数の変動要因となりました。

台湾や韓国市場は、期初に欧米の金融不安により下落したものの、インフレ懸念の緩和とAI市場の成長期待で上昇した米国株式市場を好感して上昇しました。特にIT関連銘柄を中心に台湾の上昇が目立ったほか、国内のインフレ懸念の緩和や長期金利の安定期待からインドも上昇しました。ただし8月以降、米国で利上げ打ち止め期待が後退すると、投資対象の株式市場も軟調な展開となりました。

香港や中国市場は、中国のゼロコロナ政策の撤廃や、中国人民銀行が不動産市場の安定化に向けて金融支援を強化する方針を示したことなどから景気回復期待が高まり、期初は上昇しました。しかしながら、低調な中国経済指標の発表が続いたことや、中国人民元安の加速などが嫌気され軟調となりました。その後も大手不動産企業に対する信用不安が高まったことや半導体技術を巡っての米中関係の悪化懸念などから、期末にかけて下落基調が続きました。

為替市場

米ドル・円は、堅調な米経済指標やFRB（米連邦準備制度理事会）高官のタカ派（インフレ抑制を重視する立場）的な発言などから米国の利上げ継続観測が高まり、米ドル高・円安が進みました。7月には米国のインフレ率鈍化などを背景に米ドル安・円高が進む場面もありましたが、その後は日銀が改めて大規模な金融緩和を続ける姿勢を示したことや、米国の金融引き締めが長期化するとの見方が強まったことから米ドル買い・円売りが優勢となり、期間を通じては大幅な米ドル高・円安となりました。

この期間、米ドルは投資対象市場の通貨に対しても強含みとなりましたが、円は総じて投資対象市場の通貨に対して下落しました。

▶ ポートフォリオについて（2022年12月1日から2023年11月30日まで）

株式組入比率

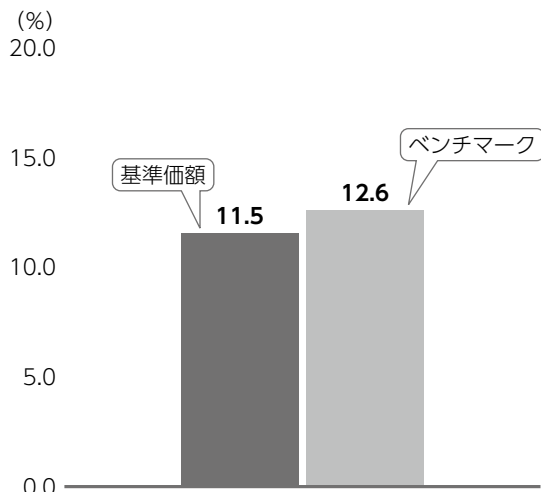
期を通じて、株式、投資信託証券および先物の組入れにより、実質株式組入比率は100%に近い高位を保ちました。

運用経過

日々の追加設定・解約による資金変動には株式指数先物取引を利用し、実質株式組入比率の調整を行い、トラッキングエラー（ポートフォリオとベンチマークのリターン乖離）を低く抑えました。

▶ ベンチマークとの差異について（2022年12月1日から2023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、円換算ベース）をベンチマークとしています。

記載のグラフは、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+11.5%となり、ベンチマークの騰落率+12.6%を1.1%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・ 売買コスト、保管費用等の支払いが生じたこと
- ・ ベンチマークと先物にリターンの差異が生じたこと
- ・ 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。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 (2022年12月1日から2023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) (投 資 信 託 証 券)	19円 (15) (3) (1)	0.111% (0.085) (0.017) (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) (投 資 信 託 証 券)	4 (4) (0)	0.025 (0.025) (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	17 (15) (2)	0.098 (0.086) (0.011)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	40	0.233	

期中の平均基準価額は17,294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12月1日から2023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 (1,047.45 31.66)	千アメリカ・ドル 2,258 (-)	百株 942.47	千アメリカ・ドル 1,397
	香 港	百株 (97,803 198.5)	千香港・ドル 151,060 (△ 282)	百株 14,642.68	千香港・ドル 4,186
	台 湾	百株 (38,310 770.66)	千台湾・ドル 330,038 (△ 1,606)	百株 325	千台湾・ドル 3,553
	エ ジ プ ト	百株 (655.76 39.81)	千エジプト・ポンド 2,240 (-)	百株 -	千エジプト・ポンド -
	ト ル コ	百株 (3,589.93 634.88)	千トルコ・リラ 14,965 (-)	百株 -	千トルコ・リラ -
	メ キ シ コ	百株 (6,013.85 839)	千メキシコ・ペソ 27,496 (-)	百株 4,823.55	千メキシコ・ペソ 6,143

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 国	フィリピン	百株 2,831.65 (111.08)	千フィリピン・ペソ 24,432 (△24)	百株 5,143.5	千フィリピン・ペソ 7,548
	チリ	百株 19,756.57 (5.8)	千チリ・ペソ 334,514 (-)	百株 3.27	千チリ・ペソ 211
	コロンビア	百株 133.03	千コロンビア・ペソ 315,337	百株 1,345.24	千コロンビア・ペソ 306,593
	インド	百株 16,106.55 (1,992.67)	千インド・ルピー 973,211 (-)	百株 538.11	千インド・ルピー 31,883
	インドネシア	百株 346,395 (8,533.21)	千インドネシア・ルピア 22,823,061 (-)	百株 4,168.1	千インドネシア・ルピア 1,023,272
	ブラジル	百株 8,216 (150.94)	千ブラジル・レアル 18,203 (-)	百株 509.23	千ブラジル・レアル 1,026
	チェコ	百株 93.97	千チェコ・コルナ 2,524	百株 -	千チェコ・コルナ -
	韓国	百株 1,862.54 (1.14)	千韓国・ウォン 12,486,943 (△746)	百株 155.67	千韓国・ウォン 430,523
	マレーシア	百株 10,926	千マレーシア・リンギット 5,113	百株 2,685	千マレーシア・リンギット 328
	南アフリカ	百株 3,484.28 (-)	千南アフリカ・ランド 41,631 (△153)	百株 363.64	千南アフリカ・ランド 5,346
	タイ	百株 25,704.5 (△149.83)	千タイ・バーツ 56,670 (-)	百株 2,216	千タイ・バーツ 6,171
	ポーランド	百株 550.97	千ポーランド・ズロチ 2,725	百株 176.93	千ポーランド・ズロチ 216
	ハンガリー	百株 131.61	千ハンガリー・フォリント 87,016	百株 -	千ハンガリー・フォリント -
ユーロ	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ	
ギリシャ	(957.08 -)	(△409 2)	20.4	33	

※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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(2) 投資信託証券

			買 付		売 付	
			口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外	ア メ リ カ	ISHRS MSCI SAUDI ARABIA ETF	□ 74,016	千アメリカ・ドル 2,889	□ —	千アメリカ・ドル —
		ISHARES MSCI UAE ETF	73,982	1,131	779	11
		ISHARES MSCI QATAR ETF	38,799	731	2,202	40
		ISHARES MSCI KUWAIT ETF	24,927	846	2,203	68
	香 港	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	□ — (4,253)	千香港・ドル — (—)	□ 4,253 (—)	千香港・ドル 6 (—)
		TRUST FIBRA UNO	□ 32,700	千メキシコ・ペソ 815	□ —	千メキシコ・ペソ —
	メ キ シ コ	CEMEX SAB-CPO	141,700	1,539	—	—
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	3,630	482	—	—
		GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	20,600	438	—	—
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	19,800	3,358	—	—
		ENERGISA SA-UNITS	□ 2,100	千ブラジル・レアル 92	□ —	千ブラジル・レアル —
	ブ ラ ジ ル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	13,600	362	—	—
		KLABIN SA - UNIT	5,800	114	—	—
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	2,700	75	—	—
		CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	□ 692,000	千オフショア・人民元 27,596	□ —	千オフショア・人民元 —
	中 国	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	□ 65,273	千南アフリカ・ランド 830	□ —	千南アフリカ・ランド —
南 ア フ リ カ						

※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。

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 21,976	百万円 24,603	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

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	10,098,817千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	25,497,337千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.39

※(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12月1日から2023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

(2022年12月1日から2023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 (2023年11月30日現在)

(1) 外国株式

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			株数	金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
YUM CHINA HOLDINGS INC	103.89	144.99	623	91,691	消費者サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	40.68	74.95	71	10,570	素材
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	12.01	20.74	124	18,246	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SOUTHERN COPPER CORP	20.96	29.56	212	31,201	素材
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	134.47	—	—	—	消費者サービス
CREDICORP LTD	17.64	23.25	292	43,060	銀行
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	106.92	121.37	198	29,148	一般消費財・サービス流通・小売り
TAL EDUCATION GROUP- ADR	111.21	142.39	170	25,129	消費者サービス
JOYY INC-ADR	11.64	15.6	60	8,826	メディア・娯楽
AUTOHOME INC-ADR	20.9	27.73	72	10,729	メディア・娯楽
WEIBO CORP-SPON ADR	14.72	27.29	30	4,543	メディア・娯楽
H WORLD GROUP LTD-ADR	47.6	71.99	253	37,215	消費者サービス
PDD HOLDINGS INC	124.66	207.79	2,945	433,122	一般消費財・サービス流通・小売り
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	104.16	148.97	332	48,879	運輸
NIO INC - ADR	338.95	481.47	345	50,841	自動車・自動車部品
XPENG INC - ADR	104.39	—	—	—	自動車・自動車部品
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	14.69	22.05	53	7,873	半導体・半導体製造装置
LI AUTO INC - ADR	134.78	—	—	—	自動車・自動車部品
KANZHUN LTD - ADR	44.91	76.08	127	18,708	メディア・娯楽
MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	—	29.98	77	11,432	一般消費財・サービス流通・小売り
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	124.3	209.96	41	6,092	ソフトウェア・サービス
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	277.8	—	—	—	不動産管理・開発
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	262	367	54	7,945	エネルギー
BEIGENE LTD-ADR	11.63	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUTCHMED CHINA-ADR	14.44	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IQIYI INC-ADR	71.66	137.29	61	9,065	メディア・娯楽
KE HOLDINGS INC-ADR	164.24	236.35	376	55,442	不動産管理・開発
LUFAX HOLDING LTD-ADR	188.37	188.37	15	2,329	金融サービス
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	103.43	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	191.74	261.03	217	31,978	メディア・娯楽
ZAI LAB LTD-ADR	21.72	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QIFU TECHNOLOGY INC	26.69	37.64	58	8,635	金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数〈比率〉	2,967.2 31銘柄	3,103.84 24銘柄	6,817 —	1,002,711 〈2.7%〉
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	2,710	3,270	1,222	23,040	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,040	1,520	516	9,736	資本財
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	130	290	1,022	19,259	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	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	865	1,320	546	10,295	金融サービス
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	770	1,230	312	5,885	商業・専門サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	680	1,040	1,216	22,924	ソフトウェア・サービス
KINGSOFT CORP LTD	202	336	855	16,110	メディア・娯楽
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	1,880	4,000	304	5,727	金融サービス
WHARF HOLDINGS LTD	300	—	—	—	不動産管理・開発
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	290	—	—	—	エネルギー
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	381.4	381.4	385	7,257	運輸
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,000	1,000	156	2,939	公益事業
KINGBOARD HOLDINGS LTD	135	185	359	6,768	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	1,290	1,660	793	14,949	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INTL HOLDINGS	270	495	292	5,511	運輸
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	105	165	286	5,390	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	1,480	2,190	1,918	36,143	自動車・自動車部品
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	220	500	345	6,499	運輸
DONGYUE GROUP	430	430	258	4,868	素材
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	280	280	142	2,685	食品・飲料・タバコ
CGN POWER CO LTD-H	2,290	3,330	622	11,731	公益事業
CHINA VANKE CO LTD-H	392	789	623	11,743	不動産管理・開発
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	140	190	343	6,471	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	420	580	2,021	38,081	食品・飲料・タバコ
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	530	—	—	—	不動産管理・開発
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	1,000	2,080	960	18,104	生活必需品流通・小売り
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	2,600	—	—	—	メディア・娯楽
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	30	40	377	7,102	運輸
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	480	600	573	10,795	食品・飲料・タバコ
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	225	455	369	6,952	不動産管理・開発
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	300	500	322	6,066	不動産管理・開発
JIANGXI COPPER CO LTD-H	200	310	342	6,447	素材
CHINA GAS HOLDINGS LTD	796	944	679	12,805	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	6,460	8,820	3,536	66,633	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	105	170	438	8,263	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	860	860	331	6,237	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MINTH GROUP LTD	220	220	383	7,220	自動車・自動車部品
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	—	545	266	5,020	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	660	1,000	666	12,547	ソフトウェア・サービス
YIHA! INTERNATIONAL HOLDING	90	160	214	4,045	食品・飲料・タバコ
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	700	700	277	5,235	自動車・自動車部品
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	445	565	329	6,205	資本財
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	324	432	419	7,902	金融サービス
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	540	540	184	3,469	資本財
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	320	320	154	2,917	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	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	190	390	317	5,980	資本財
FOSUN INTERNATIONAL LTD	720	720	338	6,375	資本財
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	120	220	102	1,931	一般消費財・サービス流通・小売り
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	440	440	127	2,395	運輸
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	210	290	390	7,364	消費者サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	1,542	2,332	73,924	1,392,735	メディア・娯楽
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	540	740	546	10,288	不動産管理・開発
XIAOMI CORP-CLASS B	3,770	5,406	8,368	157,662	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIR CHINA LTD-H	560	560	294	5,549	運輸
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	133.1	—	—	—	不動産管理・開発
ZTE CORP-H	166	238	401	7,559	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	185	—	—	—	不動産管理・開発
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	960	1,600	142	2,682	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	520	600	889	16,752	公益事業
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	157	237	294	5,554	ヘルスケア機器・サービス
PETROCHINA CO LTD-H	5,200	7,500	3,802	71,639	エネルギー
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	270	440	661	12,467	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN-CLASS B	1,089	1,770.6	16,015	301,724	消費者サービス
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	165	330	597	11,265	一般消費財・サービス流通・小売り
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	3,746	5,715	41,548	782,765	一般消費財・サービス流通・小売り
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	495	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	1,140	1,520	579	10,910	公益事業
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	885	1,350	6,034	113,689	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	325	390	712	13,431	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	870	1,050	619	11,671	公益事業
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	1,040	—	—	—	不動産管理・開発
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,960	2,510	865	16,314	銀行
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	490	490	310	5,843	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	23,790	33,640	15,070	283,932	銀行
CHINA FEIHE LTD	980	1,270	579	10,910	食品・飲料・タバコ
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	25	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JD.COM INC-CLASS A	534.35	822.85	8,771	165,256	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	354	610	422	7,964	保険
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	1,200	1,540	689	12,998	半導体・半導体製造装置
NETEASE INC	511	678	11,987	225,835	メディア・娯楽
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	275	408	1,511	28,479	生活必需品流通・小売り
HAIER SMART HOME CO LTD-H	566	820	1,853	34,914	耐久消費財・アパレル
KUAISHOU TECHNOLOGY	431	821	4,675	88,088	メディア・娯楽
CHINA TOWER CORP LTD-H	11,080	14,000	1,120	21,100	電気通信サービス
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	2,200	3,030	1,078	20,322	銀行
WUXI APPTEC CO LTD-H	87.11	137.11	1,279	24,100	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	120	—	—	—	ソフトウェア・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	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	310	590	907	17,095	消費者サービス
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	375	520	3,208	60,446	消費者サービス
POP MART INTERNATIONAL GROUP	118	210	486	9,159	一般消費財・サービス流通・小売り
HENGAN INTL GROUP CO LTD	150	255	714	13,451	家庭用品・パーソナル用品
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	160	360	284	5,364	消費者サービス
NONGFU SPRING CO LTD-H	448	634	2,773	52,257	食品・飲料・タバコ
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	400	720	267	5,032	運輸
BAIDU INC-CLASS A	543.5	790.5	9,098	171,418	メディア・娯楽
BEIGENE LTD	—	247	2,709	51,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BILIBILI INC-CLASS Z	48.8	59.8	603	11,378	メディア・娯楽
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	835	1,215	3,073	57,913	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	2,288	3,248	2,273	42,834	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOPHARM GROUP CO-H	332	424	805	15,177	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES LAND LTD	800	1,140	3,220	60,674	不動産管理・開発
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	298	—	—	—	資本財
YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	380	720	1,042	19,641	エネルギー
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	249	292	716	13,505	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LTD	380	660	354	6,677	運輸
MMG LTD	800	—	—	—	素材
BYD CO LTD-H	205	365	7,730	145,646	自動車・自動車部品
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	7,440	10,490	3,000	56,522	銀行
CHINA RESOURCES CEMENT	520	780	141	2,674	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	217	301	466	8,789	保険
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,740	3,080	770	14,506	保険
CITIC LTD	1,430	1,930	1,399	26,361	資本財
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	330	570	259	4,896	耐久消費財・アパレル
IND & COMM BK OF CHINA-H	14,060	22,880	8,511	160,354	銀行
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	84	108	518	9,776	ヘルスケア機器・サービス
GDS HOLDINGS LTD-CL A	239	239	243	4,592	ソフトウェア・サービス
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	—	23	195	3,691	一般消費財・サービス流通・小売り
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	—	210	334	6,298	不動産管理・開発
GUANGDONG INVESTMENT LTD	620	920	494	9,325	公益事業
XPENG INC - CLASS A SHARES	—	359	2,428	45,755	自動車・自動車部品
LI AUTO INC-CLASS A	—	396	6,039	113,774	自動車・自動車部品
JD LOGISTICS INC	—	705	683	12,883	運輸
TRIP.COM GROUP LTD	—	194	5,292	99,707	消費者サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	945	1,385	1,997	37,626	不動産管理・開発
ZAI LAB LTD	—	299	621	11,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CRRC CORP LTD - H	850	1,440	455	8,572	資本財
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	330	540	557	10,499	素材
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	130	210	415	7,833	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	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	210	210	148	2,801	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COAL ENERGY CO-H	510	510	335	6,312	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	784	1,004	706	13,316	運輸
YUEXIU PROPERTY CO LTD	296	646	460	8,677	不動産管理・開発
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	682	757	14,262	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,311	2,651	689	12,985	銀行
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,700	—	—	—	不動産管理・開発
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	135	200	440	8,289	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	308	454	3,659	68,940	耐久消費財・アパレル
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	230	—	—	—	資本財
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	160	200	1,012	19,066	食品・飲料・タバコ
GOLDWIND SCIENCE&TECHNOLOGY	162.18	—	—	—	資本財
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	812	812	298	5,629	自動車・自動車部品
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	204	300	2,340	44,085	耐久消費財・アパレル
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,575	2,350	8,401	158,279	保険
CHINA MENGNIU DAIRY CO	800	1,130	2,740	51,626	食品・飲料・タバコ
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,700	2,500	2,257	42,531	保険
LI NING CO LTD	580	850	1,814	34,189	耐久消費財・アパレル
GREAT WALL MOTOR CO LTD-H	815	850	977	18,416	自動車・自動車部品
WEICHAI POWER CO LTD-H	460	680	987	18,601	資本財
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	510	990	345	6,509	資本財
CHINA POWER INTERNATIONAL	1,480	1,480	420	7,918	公益事業
SUNNY OPTICAL TECH	182	262	1,924	36,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	720	1,100	419	7,895	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	650	968	1,606	30,273	保険
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	166	247	277	5,221	ヘルスケア機器・サービス
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,890	2,660	2,808	52,920	保険
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	200	290	1,542	29,066	公益事業
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	370	370	145	2,746	素材
KUNLUN ENERGY CO LTD	1,060	1,220	872	16,434	公益事業
CHINA OILFIELD SERVICES-H	380	740	617	11,627	エネルギー
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,420	1,820	2,224	41,900	素材
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	—	520	399	7,523	エネルギー
LENOVO GROUP LTD	1,780	2,400	2,304	43,407	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	420	640	569	10,731	資本財
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,040	1,220	425	8,021	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	2,160	3,250	1,488	28,043	銀行
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	90	90	174	3,292	家庭用品・パーソナル用品
CHINA EVERGRANDE GROUP	660	—	—	—	不動産管理・開発
FAR EAST HORIZON LTD	280	420	238	4,502	金融サービス
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	—	6,420	674	12,700	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		
SINOTRUK HONG KONG LTD	100	300	484	9,133	資本財	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	135	194	473	8,918	資本財	
CHINA MERCHANTS BANK-H	980	1,385	3,787	71,365	銀行	
BANK OF CHINA LTD-H	19,810	27,950	7,937	149,548	銀行	
CMOC GROUP LTD-H	660	1,500	663	12,490	素材	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	720	1,040	333	6,289	耐久消費財・アパレル	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	480	645	1,037	19,540	金融サービス	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	608	808	355	6,697	金融サービス	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	27	37	445	8,399	食品・飲料・タバコ	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	770	770	167	3,147	銀行	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	142.5	250	381	7,187	素材	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	182.5	—	—	—	不動産管理・開発	
INNOVET BIOLOGICS INC	230	425	1,863	35,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	26	—	—	—	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	51	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GF SECURITIES CO LTD-H	272	272	260	4,899	金融サービス	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	168	236	867	16,339	自動車・自動車部品	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	149	198	386	7,289	保険	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	320	584	719	13,555	金融サービス	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	90	170	215	4,061	半導体・半導体製造装置	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	84	146	367	6,917	素材	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	672	784	570	10,752	ヘルスケア機器・サービス	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	475	630	859	16,189	不動産管理・開発	
BOC AVIATION LTD	61	61	340	6,407	資本財	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	470	940	580	10,944	素材	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	340	—	—	—	不動産管理・開発	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	300	360	786	14,819	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
EAST BUY HOLDING LTD	—	130	386	7,274	消費者サービス	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	135	242	432	8,151	生活必需品流通・小売り	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	256	384	555	10,461	消費者サービス	
HANSON PHARMACEUTICAL GROUP	340	340	514	9,685	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	440	580	402	7,583	食品・飲料・タバコ	
AKESO INC	—	150	744	14,031	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	960	1,720	301	5,670	メディア・娯楽	
SEAZEN GROUP LTD	320	—	—	—	不動産管理・開発	
3SBIO INC	305	690	507	9,554	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA LITERATURE LTD	122	122	324	6,113	メディア・娯楽	
DALI FOODS GROUP CO LTD	510	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	340	480	700	13,203	自動車・自動車部品	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	158	234	682	12,850	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	203,101.44	286,460.26	384,338	7,240,935	
	銘柄数 <比率>	195銘柄	187銘柄	—	<19.5%>	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
SILERGY CORP	88	108	4,617	21,753	半導体・半導体製造装置
CHAILLEASE HOLDING CO LTD	338.36	508.32	9,302	43,828	金融サービス
ADVANTECH CO LTD	112.99	157.27	5,567	26,231	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	20	20	3,120	14,700	資本財
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	40	60	3,504	16,509	耐久消費財・アパレル
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	40	60	2,064	9,724	耐久消費財・アパレル
GLOBALWAFERS CO LTD	50	70	4,088	19,261	半導体・半導体製造装置
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	830	1,100	13,970	65,821	半導体・半導体製造装置
PARADE TECHNOLOGIES LTD	20	30	3,225	15,194	半導体・半導体製造装置
WIWYNN CORP	20	30	5,340	25,159	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOMO.COM INC	12	24.2	1,241	5,849	一般消費財・サービス流通・小売り
EMEMORY TECHNOLOGY INC	20	20	5,160	24,311	半導体・半導体製造装置
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	800	1,030	3,074	14,486	半導体・半導体製造装置
PHARMAESSENTIA CORP	—	90	3,303	15,562	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TAIWAN CEMENT	1,496.76	2,346.76	8,037	37,870	素材
ASIA CEMENT CORP	570	730	3,066	14,445	素材
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	1,190	1,730	12,490	58,850	食品・飲料・タバコ
FORMOSA PLASTICS CORP	1,050	1,260	10,256	48,324	素材
NAN YA PLASTICS CORP	1,210	1,710	11,696	55,108	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	870	1,280	8,230	38,778	素材
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	790	1,050	3,213	15,138	資本財
WALSIN LIHWA CORP	550	1,080	4,249	20,023	資本財
CHINA STEEL CORP	2,990	4,240	11,108	52,340	素材
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	440	630	2,979	14,040	自動車・自動車部品
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	70	102	7,099	33,448	一般消費財・サービス流通・小売り
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	490	730	7,957	37,490	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNITED MICROELECTRONICS CORP	2,920	3,990	19,630	92,492	半導体・半導体製造装置
DELTA ELECTRONICS INC	480	690	21,873	103,056	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HON HAI PRECISION INDUSTRY	3,078	4,368	44,553	209,918	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	880	1,570	4,827	22,746	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YAGEO CORPORATION	89.12	109.12	6,536	30,796	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	6,080	8,570	491,918	2,317,720	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	610	1,180	3,357	15,817	半導体・半導体製造装置
ACCTON TECHNOLOGY CORP	120	180	9,684	45,627	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	280	370	2,512	11,836	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC	610	1,110	3,923	18,487	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVENTEC CORP	720	870	3,619	17,052	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASUSTEK COMPUTER INC	170	250	9,750	45,938	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	—	180	4,383	20,650	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	140	270	4,887	23,025	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	110	180	8,325	39,224	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	
QUANTA COMPUTER INC	700	950	19,095	89,968	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	260	350	2,597	12,236	半導体・半導体製造装置
AUO CORP	1,616	2,226	3,672	17,305	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	960	1,350	16,200	76,327	電気通信サービス
MEDIATEK INC	370	530	50,244	236,729	半導体・半導体製造装置
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	180	210	4,126	19,442	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVERGREEN MARINE CORP LTD	250.96	390.96	4,378	20,630	運輸
YANG MING MARINE TRANSPORT	430	550	2,340	11,026	運輸
CHINA AIRLINES LTD	630	1,060	2,231	10,512	運輸
WAN HAI LINES LTD	146.05	256.05	1,191	5,615	運輸
EVA AIRWAYS CORP	590	910	2,821	13,291	運輸
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	997.41	1,893.59	3,398	16,014	銀行
TAIWAN BUSINESS BANK	—	2,130.32	2,875	13,550	銀行
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	2,189.7	2,929.7	6,459	30,436	銀行
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,879.5	2,718.97	17,319	81,604	保険
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	2,000	3,310	15,143	71,348	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	3,811.96	5,361.96	6,756	31,831	保険
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	3,246.69	5,043.6	12,886	60,715	銀行
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2,462.84	3,680.13	9,549	44,995	金融サービス
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,817	3,905.85	15,291	72,046	銀行
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,656.47	3,899.12	7,037	33,159	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	3,234.32	4,144.32	3,738	17,612	保険
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	2,527.37	3,475.51	6,533	30,785	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	4,430	6,130	16,459	77,548	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,611.47	3,785.01	10,408	49,041	銀行
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	130	210	5,670	26,714	生活必需品流通・小売り
LARGAN PRECISION CO LTD	24.8	34.8	8,299	39,105	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	140	190	9,728	45,834	半導体・半導体製造装置
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	310	500	8,750	41,226	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	430	600	5,934	27,958	電気通信サービス
WISTRON CORP	—	880	8,210	38,684	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GLOBAL UNICHIP CORP	—	30	4,875	22,969	半導体・半導体製造装置
INNOLUX CORP	2,425.4	2,921.63	3,681	17,344	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD	335.2	625.2	4,782	22,534	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	360	510	4,131	19,463	電気通信サービス
PEGATRON CORP	530	680	5,555	26,175	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	190	250	1,987	9,364	半導体・半導体製造装置
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	2,421.08	3,655.63	9,760	45,987	銀行
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	240	400	3,380	15,925	エネルギー
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	410	640	1,910	9,001	運輸
WIN SEMICONDUCTORS CORP	60	—	—	—	半導体・半導体製造装置
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	5	—	—	—	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	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	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	882.99	1,212.99	5,494	25,889	銀行	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	60	60	1,506	7,095	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
E INK HOLDINGS INC	220	270	4,819	22,707	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
POU CHEN	540	700	2,163	10,191	耐久消費財・アパレル	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	106.4	152.76	2,795	13,171	耐久消費財・アパレル	
GIANT MANUFACTURING	70	100	1,855	8,740	耐久消費財・アパレル	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	362.7	434.43	1,557	7,337	不動産管理・開発	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	30	50	5,425	25,560	資本財	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	140	190	1,985	9,354	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>	81,816.54 87銘柄	120,572.2 90銘柄	1,154,759 -	5,440,762 <14.7%>	
(エジプト)	百株	百株	千エジプト・ポンド	千円		
EASTERN CO SAE	135.58	472.71	1,238	5,884	食品・飲料・タバコ	
COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	559.39	878.02	6,848	32,540	銀行	
EFG HOLDING S. A. E.	159.25	199.06	373	1,773	金融サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	854.22 3銘柄	1,549.79 3銘柄	8,460 -	40,198 <0.1%>	
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円		
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	192.91	385.82	1,851	9,415	資本財	
HACI OMER SABANCI HOLDING	271.03	354.57	2,210	11,239	銀行	
SASA POLYESTER SANAYI	-	380.18	1,942	9,876	素材	
HEKTAS TICARET T. A. S	-	317.31	725	3,687	素材	
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	-	376.77	862	4,382	素材	
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	-	18.52	1,324	6,732	運輸	
AKBANK T. A. S.	707.66	1,082.88	3,673	18,674	銀行	
TURKIYE IS BANKASI-C	862.59	1,280.81	2,810	14,286	銀行	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	270.8	420.53	2,407	12,239	電気通信サービス	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	26.5	326.27	5,053	25,694	エネルギー	
TURK HAVA YOLLARI AO	130.66	188.32	4,802	24,414	運輸	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	397.92	479.08	2,426	12,336	資本財	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	-	47.52	1,190	6,051	自動車・自動車部品	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16.88	25.71	2,164	11,005	自動車・自動車部品	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	388.81	486.57	2,005	10,196	素材	
KOC HOLDING AS	155.38	264.41	3,786	19,249	資本財	
YAPI VE KREDI BANKASI	-	1,174.3	2,271	11,546	銀行	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	121.75	158.13	4,933	25,082	生活必需品流通・小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,542.89 12銘柄	7,767.7 18銘柄	46,442 -	236,112 <0.6%>	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	304	304	653	5,562	電気通信サービス	
SITIOS LATINOAMERICA SAB DE	348.55	-	-	-	電気通信サービス	
BANCO DEL BAJIO SA	-	269	1,489	12,676	銀行	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	—	6,619	10,232	87,088	電気通信サービス
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	51.05	71.95	1,204	10,254	運輸
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	89	128	3,247	27,638	運輸
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	6,971	—	—	—	電気通信サービス
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	319	474	1,622	13,808	家庭用品・パーソナル用品
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,315	1,849	12,382	105,384	生活必需品流通・小売り
GRUMA S. A. B. -B	50.5	64.25	2,065	17,582	食品・飲料・タバコ
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	30.95	67.95	1,699	14,463	素材
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	111	198	2,961	25,205	資本財
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	770	1,106	8,358	71,131	素材
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	531	677	2,824	24,037	銀行
ALFA S. A. B. -A	839	1,263	1,550	13,199	資本財
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	203	401	1,443	12,282	素材
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	329	462	3,987	33,936	食品・飲料・タバコ
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	109	179	3,107	26,447	食品・飲料・タバコ
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	47.8	66	2,584	21,997	運輸
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	653	902	14,229	121,097	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	13,071.85 18銘柄	15,101.15 18銘柄	75,646 643,795	— < 1.7% >
(フィリピン)		百株	百株	千円	
AYALA LAND INC	1,980	2,379	7,172	19,047	不動産管理・開発
CONVERGE INFORMATION AND COM	474	—	—	—	電気通信サービス
PLDT INC	20.05	26.9	3,375	8,964	電気通信サービス
ACEN CORP	1,416.8	104.85	48	129	公益事業
MONDE NISSIN CORP	1,557	—	—	—	食品・飲料・タバコ
METROPOLITAN BANK & TRUST	389.8	587.2	2,985	7,929	銀行
MANILA ELECTRIC COMPANY	51.2	100.6	3,762	9,991	公益事業
SM PRIME HOLDINGS INC	2,848	3,664	11,908	31,621	不動産管理・開発
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	492.27	665.06	6,830	18,137	銀行
AYALA CORPORATION	67.5	96.8	6,408	17,016	資本財
JOLLIBEE FOODS CORP	128.3	128.3	2,999	7,965	消費者サービス
UNIVERSAL ROBINA CORP	172.3	279.9	3,232	8,584	食品・飲料・タバコ
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	231.3	384.4	8,564	22,742	運輸
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	420.9	420.9	2,020	5,364	資本財
GLOBE TELECOM INC	6.2	—	—	—	電気通信サービス
SM INVESTMENTS CORP	54.05	90.35	7,661	20,345	資本財
BDO UNIBANK INC	520.7	823.44	10,984	29,169	銀行
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	1,109	—	—	—	金融サービス
GT CAPITAL HOLDINGS INC	13.1	—	—	—	資本財
JG SUMMIT HOLDINGS INC	825.62	825.62	3,112	8,265	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	12,778.09 20銘柄	10,577.32 15銘柄	81,068 215,277	— < 0.6% >

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
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円		
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	3,740.56	3,740.56	18,706	3,162	運輸	
ENEL CHILE SA	3,648.77	9,713.2	54,053	9,139	公益事業	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	10.84	22.23	52,440	8,866	銀行	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	15.86	53.81	28,675	4,848	食品・飲料・タバコ	
BANCO DE CHILE	10,243.25	15,308.52	147,421	24,925	銀行	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	36.01	51.51	226,644	38,320	資本財	
ENEL AMERICAS SA	6,005.05	8,433.79	83,916	14,188	公益事業	
CENCOSUD SA	400.71	400.71	62,470	10,562	生活必需品流通・小売り	
FALABELLA SA	159.11	281.82	56,899	9,620	一般消費財・サービス流通・小売り	
EMPRESAS CMPC SA	225.43	366.62	62,109	10,501	素材	
EMPRESAS COPEC SA	105.29	138.77	90,963	15,380	エネルギー	
BANCO SANTANDER CHILE	18,250.75	24,089.19	101,897	17,228	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	42,841.63 12銘柄	62,600.73 12銘柄	986,197 -	166,746 <0.4%>	
(コロンビア)	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円		
ECOPETROL SA	1,345.24	-	-	-	エネルギー	
BANCOLOMBIA SA	59.94	97.63	295,037	10,863	銀行	
BANCOLOMBIA SA-PREF	122.17	152.18	424,582	15,633	銀行	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	81.1	146.43	221,987	8,173	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,608.45 4銘柄	396.24 3銘柄	941,607 -	34,670 <0.1%>	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円		
YES BANK LTD	2,778.99	4,497.3	8,927	15,890	銀行	
INFOSYS LTD	834.06	1,160.69	169,414	301,557	ソフトウェア・サービス	
BHARAT ELECTRONICS LTD	900.96	1,342.02	18,922	33,682	資本財	
HAVELLS INDIA LTD	57.14	94.25	12,139	21,608	資本財	
INDIAN HOTELS CO LTD	-	274	11,509	20,486	消費者サービス	
VEDANTA LTD	155.67	207.29	4,839	8,613	素材	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	234.4	336.2	22,715	40,433	保険	
TECH MAHINDRA LTD	143.79	194.31	23,738	42,255	ソフトウェア・サービス	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	75.42	125.02	6,897	12,277	保険	
VARUN BEVERAGES LTD	-	156.48	16,600	29,548	食品・飲料・タバコ	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	110.98	156.55	22,039	39,231	保険	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	68.19	68.19	4,776	8,502	商業・専門サービス	
ZOMATO LTD	582.11	1,374.93	16,031	28,536	消費者サービス	
MPHASIS LTD	17.73	23.6	5,533	9,850	ソフトウェア・サービス	
SRF LTD	33.36	50.58	11,894	21,172	素材	
GODREJ PROPERTIES LTD	30.83	40.22	7,400	13,172	不動産管理・開発	
TATA ELXSI LTD	8.44	10.81	9,068	16,141	ソフトウェア・サービス	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	33.04	66.67	4,988	8,879	銀行	
TVS MOTOR CO LTD	-	76.37	14,232	25,334	自動車・自動車部品	

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	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	—	34.15	11,792	20,991	自動車・自動車部品
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	—	192.7	8,464	15,066	資本財
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	—	249.69	15,312	27,255	ヘルスケア機器・サービス
SONA BLW PRECISION FORGINGS	—	131.73	7,308	13,008	自動車・自動車部品
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	—	53.74	12,593	22,416	資本財
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	—	1,058.12	23,918	42,575	金融サービス
SUPREME INDUSTRIES LTD	—	24.23	9,985	17,774	素材
ASTRAL LTD	—	46.91	9,127	16,246	資本財
IDFC FIRST BANK LTD	—	1,128.74	9,583	17,057	銀行
SHREE CEMENT LTD	2.95	3.24	8,458	15,056	素材
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	136.3	187.6	17,513	31,173	食品・飲料・タバコ
MRF LTD	0.47	0.7	7,858	13,988	自動車・自動車部品
INDIAN OIL CORP LTD	665.26	891.26	9,674	17,220	エネルギー
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	19.06	24.86	6,420	11,427	自動車・自動車部品
DIVI'S LABORATORIES LTD	32.72	39.11	14,587	25,964	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUROBINDO PHARMA LTD	64.99	84.77	8,658	15,412	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOCON LTD	102.92	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PETRONET LNG LTD	184.86	274.36	5,465	9,728	エネルギー
BHARAT FORGE LTD	53.74	89	9,920	17,659	自動車・自動車部品
PIDILITE INDUSTRIES LTD	39.91	48.12	12,047	21,444	素材
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	25.03	32.64	6,827	12,153	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INFO EDGE INDIA LTD	17.49	22.39	10,182	18,124	メディア・娯楽
PAGE INDUSTRIES LTD	1.51	1.94	7,246	12,898	耐久消費財・アパレル
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	130.18	195.19	16,309	29,030	運輸
JUBILANT FOODWORKS LTD	93.93	143.55	8,085	14,392	消費者サービス
MUTHOOT FINANCE LTD	29.68	41.86	5,926	10,549	金融サービス
PI INDUSTRIES LTD	18.69	26.63	10,071	17,927	素材
BAJAJ FINANCE LTD	67.16	94.76	67,564	120,265	金融サービス
LTIMINDTREE LTD	22.46	32.73	18,291	32,558	ソフトウェア・サービス
ADANI GREEN ENERGY LTD	78.09	120.08	12,508	22,265	公益事業
INDRAPRASTHA GAS LTD	66.11	118.56	4,627	8,236	公益事業
TRENT LTD	43.08	67.71	18,121	32,256	一般消費財・サービス流通・小売り
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	—	29.68	8,704	15,493	金融サービス
BANDHAN BANK LTD	135.22	265.91	5,912	10,524	銀行
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	26.72	37.67	18,095	32,209	食品・飲料・タバコ
EICHER MOTORS LTD	33.7	47.55	18,127	32,266	自動車・自動車部品
BERGER PAINTS INDIA LTD	69.33	83.19	4,775	8,500	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD	39.92	56.54	21,832	38,862	生活必需品流通・小売り
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	59.3	75.94	10,939	19,473	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	20.35	43.38	11,667	20,767	運輸
ADANI TOTAL GAS LTD	67.78	—	—	—	公益事業
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	101.22	140.64	15,617	27,798	金融サービス

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	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	49.49	100.68	7,422	13,211	金融サービス
ADANI ENERGY SOLUTIONS LTD	70.36	—	—	—	公益事業
TATA STEEL LTD	1,806.37	2,627.81	33,570	59,755	素材
CIPLA LTD	119.34	190.15	22,847	40,668	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXIS BANK LTD	568.86	792.08	83,972	149,470	銀行
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	29.79	47.23	50,060	89,107	自動車・自動車部品
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	—	8.59	6,278	11,176	金融サービス
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	25.69	47.47	10,483	18,660	家庭用品・パーソナル用品
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	620.21	1,064.77	20,443	36,389	エネルギー
ACC LTD	16.28	—	—	—	素材
AMBUJA CEMENTS LTD	162.48	191.52	8,343	14,851	素材
ITC LTD	729.09	1,059.44	46,318	82,447	食品・飲料・タバコ
TATA POWER CO LTD	354.46	538.68	14,727	26,214	公益事業
BANK OF BARODA	—	380.09	7,502	13,355	銀行
DLF LTD	152.55	219.45	13,993	24,907	不動産管理・開発
ASHOK LEYLAND LTD	—	561.14	10,181	18,123	資本財
ASIAN PAINTS LTD	95.11	136.24	42,893	76,349	素材
NESTLE INDIA LTD	8.32	12.17	29,290	52,136	食品・飲料・タバコ
HINDUSTAN UNILEVER LTD	205.15	289.64	73,135	130,181	家庭用品・パーソナル用品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	157.34	157.34	5,388	9,590	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	440	620.35	35,273	62,786	銀行
ICICI BANK LTD	1,275.6	1,799.56	169,086	300,974	銀行
RELIANCE INDUSTRIES LTD	752.44	1,058.96	254,224	452,519	エネルギー
SIEMENS LTD	14.95	28.62	10,405	18,521	資本財
NTPC LTD	956.15	1,560.3	40,318	71,766	公益事業
POWER FINANCE CORPORATION	—	458.76	15,051	26,792	金融サービス
UNITED SPIRITS LTD	71.65	103.02	10,822	19,264	食品・飲料・タバコ
JSW STEEL LTD	187.89	194.29	15,412	27,433	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	773.78	1,668.22	35,207	62,669	公益事業
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	65.93	100.64	7,730	13,760	運輸
TITAN CO LTD	87.54	126.54	43,394	77,241	耐久消費財・アパレル
BAJAJ FINSERV LTD	94.1	132.69	21,940	39,053	金融サービス
BAJAJ AUTO LTD	16.01	25.66	15,575	27,724	自動車・自動車部品
ABB INDIA LTD	—	20.65	8,763	15,599	資本財
BHARTI AIRTEL LTD	550.35	787.64	78,401	139,555	電気通信サービス
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	213.9	258.59	11,084	19,730	エネルギー
DR. REDDY'S LABORATORIES	28.72	39.32	22,472	40,001	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GAIL INDIA LTD	489.27	717.54	9,033	16,080	公益事業
GRASIM INDUSTRIES LTD	64.76	88.42	17,712	31,528	素材
HCL TECHNOLOGIES LTD	267.58	337.62	45,036	80,165	ソフトウェア・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	427.46	—	—	—	金融サービス
HDFC BANK LIMITED	—	969.28	151,125	269,003	銀行

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
HERO MOTOCORP LTD	27.09	38.2	14,313	25,477	自動車・自動車部品	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	345.96	416.46	21,549	38,358	素材	
LARSEN & TOUBRO LTD	173.09	242.91	74,907	133,335	資本財	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	216.36	324.14	52,481	93,417	自動車・自動車部品	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	236.58	342.26	41,146	73,240	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	225.5	317.93	111,712	198,848	ソフトウェア・サービス	
TATA MOTORS LTD	409.31	577.26	41,121	73,195	自動車・自動車部品	
WIPRO LTD	336.78	432.86	17,584	31,301	ソフトウェア・サービス	
JINDAL STEEL & POWER LTD	85.61	113.77	7,606	13,538	素材	
MARICO LTD	139.55	180.08	9,490	16,892	食品・飲料・タバコ	
ULTRATECH CEMENT LTD	24.91	41.3	36,066	64,197	素材	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	137.04	380.79	66,769	118,849	銀行	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	24.81	32.36	17,545	31,230	ヘルスケア機器・サービス	
CUMMINS INDIA LTD	—	53.73	10,067	17,919	資本財	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	107.73	142.18	14,233	25,335	家庭用品・パーソナル用品	
LUPIN LTD	48.61	65.82	8,224	14,639	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	501.06	746.23	6,906	12,293	自動車・自動車部品	
SHRIRAM FINANCE LTD	46.68	102.83	20,302	36,137	金融サービス	
UPL LTD	128.73	153.97	8,777	15,623	素材	
DABUR INDIA LTD	163.54	211.4	11,301	20,116	家庭用品・パーソナル用品	
REC LTD	—	451	15,464	27,527	金融サービス	
ADANI ENTERPRISES LTD	70.25	54.98	13,176	23,454	資本財	
ADANI POWER LTD	190.15	248	10,740	19,118	公益事業	
COAL INDIA LTD	379.79	524.68	17,962	31,973	エネルギー	
INDUS TOWERS LTD	168.9	—	—	—	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数〈比率〉	24,652.24 107銘柄	42,213.35 122銘柄	3,056,178 —	5,439,996 〈14.7%〉	
(インドネシア)		百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	711	711	746,550	7,166	食品・飲料・タバコ	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,189	—	—	—	電気通信サービス	
BANK JAGO TBK PT	1,025	—	—	—	銀行	
SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	4,101	5,242	1,473,002	14,140	生活必需品流通・小売り	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,827	2,408	874,104	8,391	家庭用品・パーソナル用品	
ADARO MINERALS INDONESIA TBK	1,716	—	—	—	素材	
UNITED TRACTORS TBK PT	387	468	1,050,660	10,086	エネルギー	
GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	—	307,871	2,893,987	27,782	一般消費財・サービス流通・小売り	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	5,160	7,312	4,039,880	38,782	資本財	
GUDANG GARAM TBK PT	108	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	912	912	583,680	5,603	素材	
KALBE FARMA TBK PT	5,200	6,657	1,068,448	10,257	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,754	2,603	1,314,515	12,619	食品・飲料・タバコ	
VALE INDONESIA TBK	521	1,038	486,822	4,673	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	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
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	877	1,439	924,557	8,875	食品・飲料・タバコ	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	12,297	17,686	6,579,192	63,160	電気通信サービス	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,839	4,982	2,603,095	24,989	銀行	
ANEKA TAMBANG TBK	1,280	3,038	516,460	4,958	素材	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	13,820	19,474	17,331,860	166,385	銀行	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	4,602	13,273	7,764,705	74,541	銀行	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	17,091	23,924	12,679,720	121,725	銀行	
ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	3,548	4,542	1,171,836	11,249	エネルギー	
BARITO PACIFIC TBK PT	6,268	8,912.11	917,947	8,812	素材	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	575	902	793,760	7,620	素材	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	5,165	8,786	869,814	8,350	電気通信サービス	
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	3,251.61	3,804.61	935,934	8,984	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	95,224.61 25銘柄	445,984.72 22銘柄	67,620,529 -	649,157 <1.8%>	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円		
AMBEV SA	1,165	1,683	2,238	67,062	食品・飲料・タバコ	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	173	262	823	24,686	保険	
WEG SA	413.6	599.6	2,046	61,311	資本財	
ATACADAO SA	142	199	225	6,743	生活必需品流通・小売り	
VIBRA ENERGIA SA	286.8	402.8	911	27,297	一般消費財・サービス流通・小売り	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,144.19	1,745.19	776	23,267	ヘルスケア機器・サービス	
MAGAZINE LUIZA SA	749	1,104	207	6,218	一般消費財・サービス流通・小売り	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	-	437	575	17,242	生活必需品流通・小売り	
PRIIO SA	174	278	1,276	38,238	エネルギー	
ENEVA SA	-	322	397	11,914	公益事業	
BANCO BRADESCO S.A.	394.81	594.81	841	25,216	銀行	
SUZANO SA	193.15	284.15	1,541	46,184	素材	
LOCALIZA RENT A CAR	189.3	322.3	1,908	57,193	運輸	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	176	268	662	19,848	エネルギー	
TOTVS SA	129	184	616	18,456	ソフトウェア・サービス	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	228	331	1,130	33,875	公益事業	
TELEFONICA BRASIL S.A.	113	135	710	21,282	電気通信サービス	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	42.5	64.5	279	8,359	公益事業	
NATURA &CO HOLDING SA	221	284	460	13,801	家庭用品・パーソナル用品	
TIM SA	182	294	501	15,018	電気通信サービス	
RUMO SA	340	476	1,090	32,657	運輸	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	99	202	526	15,783	ヘルスケア機器・サービス	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	1,174	1,673	5,893	176,584	エネルギー	
BANCO BRADESCO SA-PREF	1,335.36	1,846.36	2,978	89,226	銀行	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	146	209	340	10,200	素材	
VALE SA	986.88	1,191.88	8,754	262,282	素材	
GERDAU SA-PREF	299	424.4	948	28,418	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	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	917	1,309	4,889	146,478	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	342.99	438.99	474	14,230	公益事業
ITAUSA SA	1,258.05	1,884.8	1,799	53,927	銀行
BRASKEM SA-PREF A	40	—	—	—	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	57	80	357	10,718	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	212	311	1,639	49,131	銀行
COSAN SA	299.88	425.88	744	22,316	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	268.05	437.05	1,780	53,345	公益事業
CCR SA	327	327	437	13,108	運輸
BRF SA	150	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	93	108	721	21,624	公益事業
CPFL ENERGIA SA	48	73	264	7,930	公益事業
LOJAS RENNER S. A.	243.58	296.58	477	14,296	一般消費財・サービス流通・小売り
JBS SA	184	237	550	16,480	食品・飲料・タバコ
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,536	2,022	2,679	80,267	金融サービス
HYPERA SA	101	130	431	12,930	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RAIA DROGASIL SA	242	432.8	1,226	36,734	生活必需品流通・小売り
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	1,210	1,684	5,238	156,959	銀行
AMERICANAS SA	130.24	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	18,156.38 44銘柄	26,014.09 43銘柄	62,377 —	1,868,855 < 5.0%>
(チェコ)		百株	百株	千チェコ・コルナ	千円
MONETA MONEY BANK AS	47.9	120.93	1,099	7,316	銀行
CEZ AS	41.77	58.78	5,754	38,301	公益事業
KOMERCNI BANKA AS	18.21	22.14	1,530	10,189	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	107.88 3銘柄	201.85 3銘柄	8,384 —	55,807 < 0.2%>
(韓国)		百株	百株	千韓国・ウォン	千円
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	9.69	—	—	—	保険
HANMI PHARM CO LTD	1.71	1.74	52,809	6,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUHAN CORP	12.26	19.51	120,376	13,734	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CJ LOGISTICS	2.35	—	—	—	運輸
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	21.14	21.14	94,918	10,830	自動車・自動車部品
KIA CORP	64.95	90.82	781,052	89,118	自動車・自動車部品
NETMARBLE CORP	3.37	6.78	39,934	4,556	メディア・娯楽
HD HYUNDAI	13.4	13.4	81,740	9,326	エネルギー
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	5.26	9.6	67,296	7,678	素材
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	8.24	39.07	211,759	24,161	金融サービス
SK HYNIX INC	134.59	191.06	2,491,422	284,271	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	18.49	28.16	100,953	11,518	資本財
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	7.59	10.33	270,646	30,880	保険
KAKAObANK CORP	24.98	53.65	139,490	15,915	銀行

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末			業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ECOPRO BM CO LTD	12.9	17.48	471,086	53,750	資本財	
SK BIOSCIENCE CO LTD	5.5	9.02	61,155	6,977	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SK SQUARE CO LTD	27.13	31.84	159,040	18,146	資本財	
KAKAO GAMES CORP	7.34	14.54	39,112	4,462	メディア・娯楽	
SD BIOSENSOR INC	6.04	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
KRAFTON INC	6.5	10.09	217,944	24,867	メディア・娯楽	
F&F CO LTD / NEW	5.02	5.02	42,519	4,851	耐久消費財・アパレル	
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	3.85	6.43	28,902	3,297	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LG ENERGY SOLUTION	6	16.55	739,785	84,409	資本財	
CJ CORP	4.98	—	—	—	資本財	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	4.48	8.3	101,841	11,620	資本財	
KAKAOPAY CORP	—	8.39	38,216	4,360	金融サービス	
COSMOAM&T CO LTD	—	8.21	135,136	15,419	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ECOPRO CO LTD	—	7.07	523,180	59,694	素材	
JYP ENTERTAINMENT CORP	—	11.21	105,261	12,010	メディア・娯楽	
AMOREPACIFIC GROUP	4.73	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
POSCO FUTURE M CO LTD	6.41	10.37	339,617	38,750	資本財	
HYUNDAI MOTOR CO	34.24	47.79	883,159	100,768	自動車・自動車部品	
POSCO HOLDINGS INC	19.34	25.25	1,219,575	139,153	素材	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	23.76	53.91	55,419	6,323	金融サービス	
GREEN CROSS CORP	0.79	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	13.73	—	—	—	資本財	
SAMSUNG SDI CO LTD	13.71	19.12	901,508	102,862	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	84.57	84.57	59,875	6,831	金融サービス	
MERITZ SECURITIES CO LTD	55.28	—	—	—	金融サービス	
HOTEL SHILLA CO LTD	6.8	11.59	74,871	8,542	一般消費財・サービス流通・小売り	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	13.81	18.01	263,126	30,022	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	11.58	13.65	146,737	16,742	資本財	
KOREA ZINC CO LTD	2.27	2.85	140,505	16,031	素材	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	144.96	217.85	174,715	19,935	資本財	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	—	6.68	52,571	5,998	資本財	
S-OIL CORP	12.13	17.75	122,652	13,994	エネルギー	
LG INNOTEK CO LTD	3.82	4.95	117,067	13,357	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LOTTE CHEMICAL CORP	3.6	7.23	113,511	12,951	素材	
HMM CO LTD	71.25	78.62	121,467	13,859	運輸	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	5.31	5.31	67,755	7,730	素材	
SKC CO LTD	4.96	4.96	47,417	5,410	素材	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	15.15	21.3	490,965	56,019	自動車・自動車部品	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	—	11.39	140,210	15,998	資本財	
S-1 CORPORATION	2.19	—	—	—	商業・専門サービス	
E-MART INC	5.16	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
HANON SYSTEMS	41.38	81.77	58,792	6,708	自動車・自動車部品	

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	
COWAY CO LTD	12.84	19.96	100,598	11,478	耐久消費財・アパレル
LOTTE SHOPPING CO	1.72	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	54.67	111.54	130,724	14,915	銀行
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	43.16	50.41	126,025	14,379	資本財
PAN OCEAN CO LTD	45.27	104.67	45,740	5,219	運輸
CHEIL WORLDWIDE INC	11.93	—	—	—	メディア・娯楽
KT CORP	—	20.98	69,863	7,971	電気通信サービス
LG UPLUS CORP	45.55	69.42	72,266	8,245	電気通信サービス
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	21.48	25.25	175,235	19,994	保険
KT&G CORP	27.07	34.77	307,714	35,110	食品・飲料・タバコ
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	106.18	152.35	229,591	26,196	資本財
LG DISPLAY CO LTD	48.81	72.9	90,614	10,339	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK INC	9.61	12.19	200,769	22,907	資本財
KANGWON LAND INC	20.78	36.91	57,358	6,544	消費者サービス
NAVER CORP	32.8	46.33	961,347	109,689	メディア・娯楽
KAKAO CORP	78.11	111.26	561,863	64,108	メディア・娯楽
CJ ENM CO LTD	1.44	—	—	—	メディア・娯楽
NCSOFT CORP	4.06	4.85	127,797	14,581	メディア・娯楽
LG CORP	24.59	34.69	285,151	32,535	資本財
HANWHA OCEAN CO LTD	—	19.03	51,000	5,819	資本財
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	—	15.22	92,994	10,610	半導体・半導体製造装置
POSCO INTERNATIONAL CORP	—	16.97	98,426	11,230	資本財
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	15.68	22.83	105,817	12,073	資本財
LG H&H	2.31	3.59	119,008	13,578	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	12.32	17.44	878,976	100,291	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	2.27	2.27	71,164	8,119	素材
HYUNDAI STEEL CO	18.21	27.67	97,121	11,081	素材
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	5.82	9.13	99,243	11,323	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	8.63	12.96	142,041	16,206	自動車・自動車部品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	113.8	153.13	555,861	63,423	銀行
KB FINANCIAL GROUP INC	96.57	133.23	688,799	78,591	銀行
DB INSURANCE CO LTD	9.12	17.89	145,803	16,636	保険
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	202.85	285.99	1,653,022	188,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG H&H-PRF	0.35	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
HLB INC	25.99	40.48	129,333	14,756	ヘルスケア機器・サービス
CELLTRION PHARM INC	3.47	3.64	28,974	3,305	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEEGENE INC	7.13	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BGF RETAIL CO LTD	1.93	1.93	25,572	2,917	生活必需品流通・小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	6.94	6.94	80,920	9,233	食品・飲料・タバコ
SK CHEMICALS CO LTD	1.44	—	—	—	素材
WOORI FINANCIAL GROUP INC	134.59	224.8	287,744	32,831	銀行
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	6.57	10.33	87,495	9,983	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
SAMSUNG SDS CO LTD	9.42	12.05	200,271	22,850	ソフトウェア・サービス	
ALTEOGEN INC	8.82	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAMSUNG C&T CORP	21.63	27.74	326,777	37,285	資本財	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	4.52	6.39	465,831	53,151	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PEARL ABYSS CORP	4.98	12.09	46,667	5,324	メディア・娯楽	
DOOSAN BOBCAT INC	12.93	22.1	100,002	11,410	資本財	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	22.95	34.39	245,200	27,977	ヘルスケア機器・サービス	
HYBE CO LTD	4.59	5.87	126,205	14,399	メディア・娯楽	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	1,177.29	1,662.16	12,083,903	1,378,773	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LG ELECTRONICS INC	26.22	38.52	398,296	45,445	耐久消費財・アパレル	
L&F CO LTD	5.76	8.11	136,815	15,610	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CELLTRION INC	24.86	39.21	634,025	72,342	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	8.73	13.69	79,675	9,091	金融サービス	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	57.78	97.85	181,707	20,732	公益事業	
GS HOLDINGS	11.78	11.78	49,947	5,698	資本財	
KOREAN AIR LINES CO LTD	47.01	63.88	141,174	16,108	運輸	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	5.24	7.41	131,675	15,024	運輸	
HANA FINANCIAL GROUP	72.94	106.81	440,591	50,271	銀行	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	13.12	23.79	91,234	10,409	金融サービス	
AMOREPACIFIC CORP	8.08	11.33	150,575	17,180	家庭用品・パーソナル用品	
SK INNOVATION CO LTD	13.68	21.57	306,941	35,021	エネルギー	
CJ CHEILJEDANG CORP	1.74	2.61	82,345	9,395	食品・飲料・タバコ	
HANWHA SOLUTIONS CORP	26.23	35.43	115,147	13,138	素材	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	3,875.05 111銘柄	5,583.06 104銘柄	38,224,096 —	4,361,369 <11.8%>	
(マレーシア)	百株	百株	千円	千円		
MISC BHD	285	428	308	9,735	運輸	
SIME DARBY PLANTATION BHD	593	593	269	8,523	食品・飲料・タバコ	
MR DIY GROUP M BHD	634.5	1,361.5	211	6,666	一般消費財・サービス流通・小売り	
PETRONAS DAGANGAN BHD	73	73	161	5,101	エネルギー	
MALAYAN BANKING BHD	1,220	1,945	1,758	55,547	銀行	
GENTING BHD	602	602	283	8,957	消費者サービス	
PUBLIC BANK BERHAD	3,666	5,181	2,196	69,399	銀行	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	57	57	93	2,953	銀行	
SIME DARBY BERHAD	471	938	225	7,111	資本財	
AXIATA GROUP BERHAD	529	895	205	6,503	電気通信サービス	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	86	139	298	9,441	食品・飲料・タバコ	
TOP GLOVE CORP BHD	979	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	632	1,050	743	23,485	素材	
GENTING MALAYSIA BHD	731	1,243	334	10,563	消費者サービス	
TELEKOM MALAYSIA BHD	340	340	178	5,628	電気通信サービス	
IOI CORP BHD	706	1,010	402	12,731	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		
AMMB HOLDINGS BHD	393	689	279	8,815	銀行	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,728	2,157	1,216	38,432	銀行	
TENAGA NASIONAL BHD	676	849	838	26,499	公益事業	
GAMUDA BHD	—	578	263	8,326	資本財	
PPB GROUP BERHAD	133.4	202.4	282	8,939	食品・飲料・タバコ	
HONG LEONG BANK BERHAD	160	227	433	13,697	銀行	
RHB BANK BHD	289	480	263	8,325	銀行	
PETRONAS GAS BHD	216	307	516	16,332	公益事業	
CELCOMDIGI BHD	864	1,238	511	16,152	電気通信サービス	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	147	309	225	7,126	運輸	
MAXIS BHD	579	853	332	10,509	電気通信サービス	
HAP SENG CONSOLIDATED	204	—	—	—	資本財	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	15	23	279	8,842	食品・飲料・タバコ	
QL RESOURCES BHD	292.5	292.5	158	4,999	食品・飲料・タバコ	
DIALOG GROUP BHD	905	1,352	279	8,841	エネルギー	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	377	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
INARI AMERTRON BHD	529	921	265	8,379	半導体・半導体製造装置	
IHH HEALTHCARE BHD	417	857	499	15,784	ヘルスケア機器・サービス	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	821	1,401	685	21,643	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	20,350.4	28,591.4	15,003	473,996	
	銘柄数 <比率>	34銘柄	32銘柄	—	<1.3%>	
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	—	152.68	5,494	43,134	素材	
GOLD FIELDS LTD	229.32	319.72	9,040	70,967	素材	
MR PRICE GROUP LTD	63.31	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
PEPKOR HOLDINGS LTD	350.12	700.79	1,296	10,177	一般消費財・サービス流通・小売り	
MULTICHOICE GROUP LTD	78.94	—	—	—	メディア・娯楽	
OLD MUTUAL LTD	1,160.7	1,709.15	2,006	15,751	保険	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	83.1	140.47	1,718	13,493	素材	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	21.46	30.26	5,932	46,566	銀行	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	13.08	23.21	1,871	14,694	素材	
SPAR GROUP LIMITED/THE	41.8	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
SIBANYE STILLWATER LTD	731.51	893.25	1,856	14,570	素材	
OUTSURANCE GROUP LTD	—	265.78	1,123	8,817	保険	
BID CORP LTD	82.68	121.98	5,013	39,355	生活必需品流通・小売り	
VODACOM GROUP LTD	168.89	217.5	2,151	16,892	電気通信サービス	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	129.62	183.03	4,754	37,324	生活必需品流通・小売り	
NEDBANK GROUP LTD	113.48	145.28	3,096	24,308	銀行	
BIDVEST GROUP LTD	77.35	91.28	2,147	16,861	資本財	
STANDARD BANK GROUP LTD	330.94	465.94	9,215	72,344	銀行	
SASOL LTD	139.6	207.36	4,465	35,052	素材	
REMGRO LTD	130.46	167.02	2,412	18,938	金融サービス	

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		
DISCOVERY LTD	123.09	188.55	2,552	20,033	保険	
EXXARO RESOURCES LTD	60.27	77.16	1,457	11,444	エネルギー	
KUMBA IRON ORE LTD	15.88	25.44	1,533	12,034	素材	
SANLAM LTD	439.17	612.5	4,161	32,671	保険	
FIRSTSTRAND LTD	1,244.51	1,754.62	11,819	92,780	金融サービス	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	246.38	328.47	2,242	17,603	一般消費財・サービス流通・小売り	
THE FOSCHINI GROUP LTD	69.46	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
ABSA GROUP LTD	198.53	294.64	5,095	40,002	銀行	
NASPERS LTD-N SHS	53.94	68.2	23,390	183,612	一般消費財・サービス流通・小売り	
MTN GROUP LTD	428.37	589.39	5,952	46,729	電気通信サービス	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	209.59	322.32	2,463	19,340	素材	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	24.73	35.45	637	5,003	素材	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	93.93	119.7	2,179	17,111	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	116.45	180.15	2,094	16,442	素材	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	108.79	—	—	—	素材	
CLICKS GROUP LTD	60.14	77	2,289	17,972	生活必需品流通・小売り	
NEPI ROCKCASTLE N. V.	112.59	144.14	1,673	13,135	不動産管理・開発	
REINET INVESTMENTS SCA	28.79	49.18	2,156	16,930	金融サービス	
小 計	株 数 銘柄 数	金 額 36銘柄	7,580.97	10,701.61	135,299	1,062,098
(タイ)	株 数 銘柄 数	金 額 <比率>	36銘柄	33銘柄	—	<2.9%>
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	銀行	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	—	10,778	1,692	7,140	銀行	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	192	257	7,453	31,451	素材	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	721	1,106	2,223	9,381	一般消費財・サービス流通・小売り	
SCB X PCL-NVDR	727	1,263	3,410	14,390	消費者サービス	
JMT NETWORK SERVICES-NVDR	234	306	3,052	12,880	銀行	
TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	166	—	—	—	金融サービス	
KASIKORN BANK PCL-NVDR	—	3,332.67	1,982	8,368	電気通信サービス	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	165	237	3,116	13,151	銀行	
TRUE CORP PCL-NVDR	357	544	1,373	5,796	素材	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	2,592	—	—	—	電気通信サービス	
BRUNG THAI BANK - NVDR	293	393	8,567	36,154	電気通信サービス	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,035	1,035	1,904	8,036	銀行	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	—	2,534	1,951	8,233	エネルギー	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	2,546	4,014	10,536	44,465	ヘルスケア機器・サービス	
RATCH GROUP PCL-NVDR	343	462	7,068	29,829	エネルギー	
PTT PCL-NVDR	196	379	1,326	5,597	公益事業	
THAI OIL PCL-NVDR	2,524	3,590	12,565	53,024	エネルギー	
CP ALL PCL-NVDR	248	339	1,737	7,331	エネルギー	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	1,487	2,092	10,826	45,686	生活必需品流通・小売り	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,056	1,546	9,121	38,492	運輸	
	463	762	5,067	21,384	不動産管理・開発	

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		
LAND & HOUSES PUB - NVDR	1,769	2,332	1,795	7,577	不動産管理・開発	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,068	1,546	3,045	12,852	食品・飲料・タバコ	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	617	786	3,026	12,770	素材	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	270	359	2,539	10,718	電気通信サービス	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	190	428	1,091	4,605	生活必需品流通・小売り	
CP AXTRA PCL-NVDR	—	771	1,966	8,296	生活必需品流通・小売り	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	55	104	1,393	5,880	公益事業	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	1,669	2,354	2,801	11,821	一般消費財・サービス流通・小売り	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	77	1,121	8,631	36,425	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	588	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	271	271	1,287	5,432	金融サービス	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	147	223	4,816	20,326	ヘルスケア機器・サービス	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	2,295	2,295	1,629	6,876	運輸	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	449	575	2,659	11,222	公益事業	
BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	2,216	2,216	1,717	7,247	運輸	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	209	209	559	2,359	公益事業	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	781	994	4,597	19,400	公益事業	
OSOTSPA PCL-NVDR	385	385	893	3,769	食品・飲料・タバコ	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	433	—	—	—	金融サービス	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	1,845	1,845	671	2,834	消費者サービス	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	367.91	504.91	1,956	8,256	一般消費財・サービス流通・小売り	
SCG PACKAGING PCL-NVDR	273	416	1,612	6,802	素材	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	118	—	—	—	金融サービス	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	162	162	724	3,059	金融サービス	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	148	274	1,308	5,521	公益事業	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	54	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	31,801.91 43銘柄	55,140.58 41銘柄	145,700 —	614,855 <1.7%>	
(ポーランド)		百株	百株	千ポランド・ズロチ	千円	
DINO POLSKA SA	13.1	16.69	751	27,927	生活必需品流通・小売り	
PEPCO GROUP NV	—	50.2	112	4,199	一般消費財・サービス流通・小売り	
BUDIMEX	—	5.46	301	11,207	資本財	
MBANK SA	3.02	4.77	268	9,989	銀行	
ORLEN SA	137.22	209.38	1,247	46,402	エネルギー	
LPP SA	0.23	0.35	511	19,001	耐久消費財・アパレル	
SANTANDER BANK POLSKA SA	7.51	11.43	576	21,442	銀行	
CD PROJEKT SA	14.69	24.15	251	9,357	メディア・娯楽	
PGE SA	195.08	368.13	306	11,405	公益事業	
CYFROWY POLSAT SA	57.42	57.42	70	2,615	メディア・娯楽	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	38.45	47.82	560	20,848	素材	
PKO BANK POLSKI SA	232.04	290.89	1,388	51,648	銀行	
BANK PEKAO SA	38.56	68.31	957	35,598	銀行	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数・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
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE ORANGE POLSKA SA ALLEGRO. EU SA	162.72 157.37 106.74	203.23 — 179.96	929 — 521	34,565 — 19,399	保険 電気通信サービス 一般消費財・サービス流通・小売り	
小計	1,164.15 14銘柄	1,538.19 15銘柄	8,756 —	325,608 <0.9%>		
(ハンガリー)	百株	百株	千ハンガリー・フォリント	千円		
OTP BANK PLC RICHTER GEDEON NYRT MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	41.09 23.31 81.86	82.72 52.83 142.32	118,703 45,380 39,564	50,707 19,385 16,901	銀行 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス エネルギー	
小計	146.26 3銘柄	277.87 3銘柄	203,649 —	86,995 <0.2%>		
(ユーロ…ギリシャ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
JUMBO SA MYTILINEOS S. A. MOTOR OIL (HELLAS) SA FF GROUP ALPHA SERVICES AND HOLDINGS HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA NATIONAL BANK OF GREECE PUBLIC POWER CORP EUROBANK ERGASIAS SERVICES A OPAP SA PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	28.51 23.26 — 1.23 535.92 54.06 133.89 45.79 640 47.84 —	36.5 35.56 27.8 1.23 703.99 62.84 207.83 66.3 971.48 61.74 271.91	87 128 69 0 109 82 128 70 163 91 87	14,148 20,779 11,224 95 17,669 13,376 20,811 11,446 26,469 14,738 14,088	一般消費財・サービス流通・小売り 資本財 エネルギー 耐久消費財・アパレル 銀行 電気通信サービス 銀行 公益事業 銀行 消費者サービス 銀行	
小計	1,510.5 9銘柄	2,447.18 11銘柄	1,020 —	164,848 <0.4%>		
ユーロ通貨計	1,510.5 9銘柄	2,447.18 11銘柄	1,020 —	164,848 <0.4%>		
合計	567,152.66 811銘柄	1,126,823.13 799銘柄	— —	30,124,797 <81.3%>		

※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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘	柄	期首 (前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評 価 額		組 入 比 率
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)			□	□	千アメリカ・ドル	千円	%	
	ISHRS MSCI SAUDI ARABIA ETF	166,080		240,096	9,466	1,392,309	3.8	
	ISHARES MSCI UAE ETF	130,807		204,010	3,015	443,455	1.2	
	ISHARES MSCI QATAR ETF	82,108		118,705	2,050	301,498	0.8	
	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	37,235		59,959	1,786	262,781	0.7	
小 計	口 数 ・ 金 額	416,230		622,770	16,319	2,400,045	6.5	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4銘柄		4銘柄		< 6.5% >		
(メキシコ)			□	□	千メキシコ・ペソ	千円		
	TRUST FIBRA UNO	66,400		99,100	2,706	23,033	0.1	
	CEMEX SAB-CPO	393,600		535,300	6,445	54,850	0.1	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	12,945		16,575	2,404	20,461	0.1	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	54,100		74,700	745	6,344	0.0	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	47,900		67,700	14,555	123,876	0.3	
小 計	口 数 ・ 金 額	574,945		793,375	26,856	228,566	0.6	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5銘柄		5銘柄		< 0.6% >		
(ブラジル)			□	□	千ブラジル・レアル	千円		
	ENERGISA SA-UNITS	4,800		6,900	359	10,782	0.0	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	29,100		42,700	1,481	44,391	0.1	
	KLABIN SA - UNIT	17,500		23,300	545	16,355	0.0	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	7,800		10,500	322	9,657	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	59,200		83,400	2,709	81,188	0.2	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4銘柄		4銘柄		< 0.2% >		
(香港)			□	□	千オフショア・人民元	千円		
	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	1,403,800		2,095,800	75,029	1,545,640	4.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,403,800		2,095,800	75,029	1,545,640	4.2	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1銘柄		1銘柄		< 4.2% >		
(南アフリカ)			□	□	千南アフリカ・ランド	千円		
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	72,006		137,279	1,456	11,433	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	72,006		137,279	1,456	11,433	0.0	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1銘柄		1銘柄		< 0.0% >		
合 計	口 数 ・ 金 額	2,526,181		3,732,624	-	4,266,873	11.5	
	銘 柄 数 < 比 率 >	15銘柄		15銘柄		< 11.5% >		

※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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		期	
		買建額	売建額
外国	MSCI EmgMkt	百万円 2,665	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

(2023年11月30日現在)

項目	期	
	評価額	比率
株式	千円 30,124,797	% 80.4
投資信託受益証券	1,545,640	4.1
投資証券	2,721,233	7.3
コール・ローン等、その他	3,091,204	8.2
投資信託財産総額	37,482,875	100.0

※期末における外貨建資産（37,180,281千円）の投資信託財産総額（37,482,875千円）に対する比率は99.2%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=147.07円、1香港・ドル=18.84円、1台湾・ドル=4.711円、1エジプト・ポンド=4.751円、1トルコ・リラ=5.084円、1メキシコ・ペソ=8.51円、1フィリピン・ペソ=2.655円、100チリ・ペソ=16.908円、100コロンビア・ペソ=3.682円、1インド・ルピー=1.78円、100インドネシア・ルピア=0.96円、1ブラジル・レアル=29.96円、1チェコ・コルナ=6.655円、100韓国・ウォン=11.41円、1オフショア・人民元=20.60円、1マレーシア・リングgit=31.591円、1南アフリカ・ランド=7.85円、1タイ・バーツ=4.22円、1ポーランド・ズロチ=37.184円、100ハンガリー・フォリント=42.718円、1ユーロ=161.51円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年11月30日現在)

項目	期 末
(A) 資産	37,957,843,941円
コーポレート債	2,197,491,342
株式(評価額)	30,124,797,843
投資信託受益証券(評価額)	1,545,640,595
投資証券(評価額)	2,721,233,072
未収入金	506,610,193
未収配当金	48,464,708
差入委託証拠債	813,606,188
(B) 負債	902,152,924
未払金	479,321,269
未払解約金	422,831,305
その他未払費用	350
(C) 純資産総額(A-B)	37,055,691,017
元本	20,155,110,227
次期繰越損益金	16,900,580,790
(D) 受益権総口数	20,155,110,227口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,385円

※当期における期首元本額16,108,126,428円、期中追加設定元本額7,192,409,143円、期中一部解約元本額3,145,425,344円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DCつみたてNISA・全海外株式インデックスファンド	10,969,887,995円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,325,642,113円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	66,389,165円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	210,947,221円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	130,076,082円
イオン・バランス戦略ファンド	51,158,952円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	52,016,576円
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	119,247,376円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	89,658,773円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	415,494,050円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	272,564,691円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	393,208,937円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	125,842,039円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	6,117,050円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	604,006,895円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	3,156,147,382円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	71,378,661円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	623,825円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	460,225円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	426,243円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	139,642円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	237,886円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	139,275円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,962,597円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	8,819,360円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	5,112,939円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	2,237,206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>	75,167,071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12月1日 至2023年11月30日)

項目	当 期
(A) 配当等収益	854,066,157円
受取配当金	782,408,155
受取配当利息	35,005,788
その他収益	36,726,245
支払利息	△ 74,031
(B) 有価証券売買損益	2,932,504,560
売却益	5,648,133,339
売却損	△ 2,715,628,779
(C) 先物取引等損益	△ 172,047,185
取引利益	296,631,611
取引損	△ 468,678,796
(D) その他費用等	△ 32,056,940
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,582,466,592
(F) 前期繰越損益金	10,442,483,993
(G) 解約差損益金	△ 2,360,208,275
(H) 追加信託差損益金	5,235,838,480
(I) 合計(E+F+G+H)	16,900,580,790
次期繰越損益金(I)	16,900,580,790

※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。

リート・インデックス・マザーファンド

第39期（2024年2月27日から2024年8月26日まで）

信託期間	無期限（設定日：2005年6月21日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 日本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ます。 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 組入率	純資産額
	円	%	騰落率	%			
35期（2022年8月25日）	27,322	9.7	4,623.32	9.8	0.4	99.1	9,741
36期（2023年2月27日）	25,673	△6.0	4,338.43	△6.2	0.3	98.3	11,580
37期（2023年8月25日）	26,570	3.5	4,486.82	3.4	0.3	98.9	13,212
38期（2024年2月26日）	24,929	△6.2	4,199.08	△6.4	0.3	99.9	13,425
39期（2024年8月26日）	26,111	4.7	4,399.56	4.8	0.2	99.0	15,638

※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

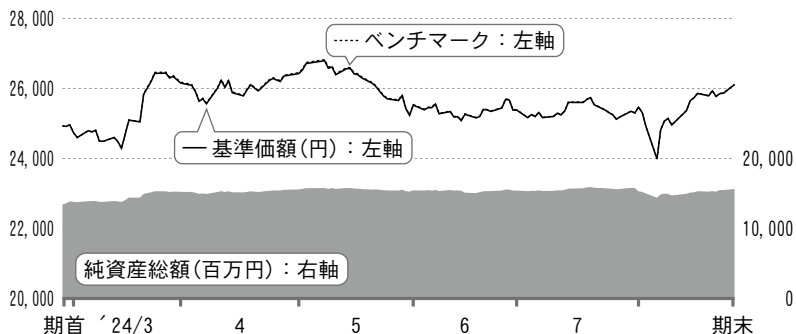
年月日	基準価額		(ベンチマーク) 東証REIT指数 (配当込み)		REIT指数 先物比率 (買建-売建)	投資信託 組入率
	円	%	騰落率	%		
(期首) 2024年2月26日	24,929	—	4,199.08	—	0.3	99.9
2月末	24,738	△0.8	4,166.74	△0.8	0.2	98.2
3月末	26,155	4.9	4,410.17	5.0	0.2	98.7
4月末	26,425	6.0	4,455.74	6.1	0.2	98.6
5月末	25,523	2.4	4,302.09	2.5	0.2	99.0
6月末	25,383	1.8	4,277.59	1.9	0.2	98.7
7月末	25,463	2.1	4,290.75	2.2	0.2	98.7
(期末) 2024年8月26日	26,111	4.7	4,399.56	4.8	0.2	99.0

※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（2024年2月27日から2024年8月26日まで）

基準価額等の推移



期首	24,929円
期末	26,111円
騰落率	+4.7%

※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（2024年2月27日から2024年8月26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	<ul style="list-style-type: none"> ・日銀の金融政策において、緩和的な姿勢が継続されたとの見通しになったこと ・日銀が追加利上げに慎重な姿勢を示したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・国内長期金利（10年国債利回り）が大きく上昇したこと ・米景気の先行き懸念が高まったこと

▶ 投資環境について（2024年2月27日から2024年8月26日まで）

Ｊリート市場は、上昇しました。

期初は日銀の政策変更への警戒感が高まる中、3月の日銀会合で金融政策が修正されたことが先行き不透明感の解消に繋がったことに加え、緩和的な金融環境を継続する意向が示されたことにより上昇しました。

5月には日銀が金融政策の正常化プロセスを早めるとの思惑から国内長期金利が大幅上昇したことで、下落に転じました。

期末にかけては、米雇用統計の結果を受けて米景気の先行き懸念が高まり、国内株式市場と同様に大きく下落するものの、その後、日銀が追加利上げに慎重な姿勢を示したことで、国内株式市場とともに大きく反発しました。

▶ ポートフォリオについて（2024年2月27日から2024年8月26日まで）

リート組入比率

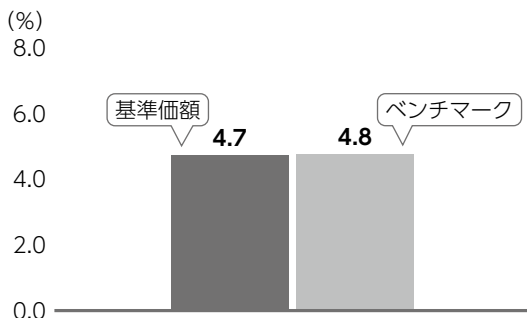
東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、リーートの組入比率は高位を保ちました。

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（2024年2月27日から2024年8月26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。

記載のグラフは、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+4.7%となり、ベンチマークの騰落率+4.8%を0.1%下方乖離しました。

下方乖離要因 ・ 現金などのキャッシュポジションが相場上昇時にマイナス寄与したこと

2 今後の運用方針

引き続き、主として日本の取引所に上場しているリートに投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。また、東証REIT指数先物を含めたリートの組入比率は、原則として高位を保ちます。

J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 (2024年2月27日から2024年8月26日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション) (投資信託証券)	4円 (0) (4)	0.014% (0.000) (0.014)	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	4	0.014	

期中の平均基準価額は25,594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 (2024年2月27日から2024年8月26日まで)

(1) 投資信託証券

	買		付		売		付	
	口数	買付額	口数	売付額	口数	売付額	口数	買付額
国内	エスコンジャパンリート投資法人	78	9,363千円	15	1,765			
	サンケイリアルエステート投資法人	90	7,815	36	3,024			
	S O S I L A 物流リート投資法人	144	16,960	71	8,108			
	東海道リート投資法人	44	5,445	16	1,901			
	日本アコモデーションファンド投資法人	102	64,264	48	30,537			
	森ヒルズリート投資法人	350	46,354	170	21,698			
	産業ファンド投資法人	985	96,929	249	30,441			
	産業ファンド新	△ 228	—	—	—			
	アドバンス・レジデンス投資法人	292	94,823	138	43,544			
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	138	52,556	115	40,637			
	GLP投資法人	974	124,796	479	62,773			
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	147	44,870	50	15,540			
	コンフォリア・レジ新	△ 4 (4)	— (1,190)	— (—)	— (—)			
	日本プロロジスリート投資法人	521	133,538	249	61,773			
	星野リゾート・リート投資法人	94	43,175	25	12,811			
	星野リゾート・リート新	△ 14 (14)	— (7,016)	— (—)	— (—)			
	Oneリート投資法人	48	12,480	19	4,838			
	イオンリート投資法人	365	48,895	178	23,118			

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	ヒューリックリート投資法人	278	40,928	214	30,468
	日本リート投資法人	93	31,443	42	13,803
	積水ハウス・リート投資法人	895	70,723	431	33,737
	トーセイ・リート投資法人	59	8,237	13	1,771
	ヘルスケア&メディカル投資法人	69	8,931	27	3,351
	サムティ・レジデンシャル投資法人	65	6,601	—	—
	野村不動産マスターファンド投資法人	965	141,392	462	66,105
	いちごホテルリート投資法人	43	4,829	14	1,536
	ラサールロジポート投資法人	381	57,032	182	26,611
	スターアジア不動産投資法人	495	28,783	130	7,507
	スターアジア不動産投 新	(111)	(5,876)	(—)	(—)
	マリモ地方創生リート投資法人	40	5,039	13	1,655
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	120	52,694	54	22,983
	日本ホテル&レジデンシャル投資法人	55	4,220	11	795
	投資法人みらい	413	18,562	203	8,974
	三菱地所物流リート投資法人	101	38,288	47	17,753
	CREロジスティクスファンド投資法人	124	18,071	61	8,766
	ザイマックス・リート投資法人	54	6,411	12	1,398
	タカラレーベン不動産投資法人	266	21,674	46	4,493
	タカラレーベン不動産投 新	△ 45	—	—	—
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	125	15,149	61	7,343
	日本ビルファンド投資法人	342	201,349	161	92,912
	ジャパンリアルエステイト投資法人	303	160,839	144	73,801
	日本都市ファンド投資法人	1,518	139,072	403	36,460
	オリックス不動産投資法人	596	95,358	286	44,422
	日本プライムリアルティ投資法人	203	66,928	97	31,416
	NTT都市開発リート投資法人	304	36,057	146	16,834
	東急リアル・エステート投資法人	201	31,921	98	14,914
	グローバル・ワン不動産投資法人	222	23,234	112	11,221
	ユナイテッド・アーバン投資法人	666	96,878	320	44,975
	森トラストリート投資法人	576	40,578	282	19,398
	インヴィンシブル投資法人	2,182	130,531	420	27,739
	インヴィンシブル投資法人 新	△ 231 (231)	(—) (14,692)	(—)	(—)
フロンティア不動産投資法人	110	48,631	53	23,036	
平和不動産リート投資法人	267	34,116	177	23,137	

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	平和不動産リート 新	△ 13 (13)	— (1,667)	— (—)	— (—)
	日本ロジスティクスファンド投資法人	200	53,436	54	14,143
	福岡リート投資法人	154	25,290	76	11,875
	KDX不動産投資法人	806	123,597	477	72,569
	いちごオフィスリート投資法人	242	19,698	259	21,242
	大和証券オフィス投資法人	54 (308)	22,693 (—)	23 (—)	6,850 (—)
	阪急阪神リート投資法人	143	19,370	72	9,399
	スターツプロシード投資法人	50	10,034	20	3,911
	大和ハウスリート投資法人	436	108,977	216	52,285
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,514	107,903	503	38,555
	ジャパン・ホテル・リート新	△ 130 (130)	— (9,822)	— (—)	— (—)
	大和証券リビング投資法人	275	28,691	75	7,537
	ジャパンエクセレント投資法人	260	31,916	144	17,186

※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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

(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 R E I T 指 数 先 物 取 引	百万円 67	百万円 68	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 (2024年2月27日から2024年8月26日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 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	$\frac{D}{C}$

(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 40

(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	2,181千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	93千円
(c) (b) / (a)	4.3%

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2024年2月27日から2024年8月26日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2024年8月26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
		口		口		千円	%
エスコンジャパンリート投資法人			275		338	40,627	0.3
サンケイリアルエステート投資法人			433		487	41,687	0.3
S O S I L A 物流リート投資法人			684		757	88,341	0.6
東海道リート投資法人			230		258	29,979	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人			470		524	347,936	2.2
森ヒルズリート投資法人		1,605		1,785		229,015	1.5
産業ファンド投資法人		2,042		2,778		346,416	2.2
産業ファンド新		228		—		—	—
アドバンス・レジデンス投資法人		1,337		1,491		498,739	3.2
アクティビア・プロパティーズ投資法人		715		738		259,407	1.7
GLP投資法人		4,601		5,096		684,392	4.4
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		670		767		241,988	1.5
日本プロロジスリート投資法人		2,372		2,644		695,900	4.4
星野リゾート・リート投資法人		251		320		164,160	1.0
Oneリート投資法人		236		265		69,324	0.4
イオンリート投資法人		1,674		1,861		247,885	1.6
ヒューリックリート投資法人		1,276		1,340		191,754	1.2
日本リート投資法人		443		494		160,550	1.0
積水ハウス・リート投資法人		4,097		4,561		379,931	2.4
トーセイ・リート投資法人		285		331		45,611	0.3
ヘルスケア&メディカル投資法人		334		376		46,210	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		326		391		40,546	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人		4,403		4,906		747,183	4.8
いちごホテルリート投資法人		221		250		31,100	0.2
ラサールロジポート投資法人		1,744		1,943		289,312	1.9
スターアジア不動産投資法人		2,105		2,470		137,332	0.9
スターアジア不動産投 新		—		111		6,171	0.0
マリモ地方創生リート投資法人		205		232		28,628	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		567		633		284,217	1.8
日本ホテル&レジデンシャル投資法人		200		244		17,714	0.1
投資法人みらい		1,880		2,090		92,587	0.6
三菱地所物流リート投資法人		471		525		204,225	1.3
CREロジスティクスファンド投資法人		590		653		101,215	0.6
ザイマックス・リート投資法人		217		259		30,950	0.2
タカラレーベン不動産投資法人		635		855		84,132	0.5
タカラレーベン不動産投 新		45		—		—	—
アドバンス・ロジスティクス投資法人		601		665		86,716	0.6
日本ビルファンド投資法人		1,589		1,770		1,148,730	7.3
ジャパンリアルエステイト投資法人		1,398		1,557		890,604	5.7
日本都市ファンド投資法人		6,529		7,644		714,714	4.6
オリックス不動産投資法人		2,714		3,024		469,929	3.0
日本プライムリアルティ投資法人		932		1,038		344,097	2.2
NTT都市開発リート投資法人		1,385		1,543		180,068	1.2

Jリート・インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首 (前期末)		期		末	
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率
東急リアル・エステート投資法人			915	1,018	156,466		1.0
グローバル・ワン不動産投資法人			1,010	1,120	115,920		0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人			3,049	3,395	492,954		3.2
森トラストリート投資法人			2,631	2,925	198,022		1.3
インヴィンシブル投資法人			6,598	8,360	535,876		3.4
フロンティア不動産投資法人			506	563	244,060		1.6
平和不動産リート投資法人			1,022	1,112	147,784		0.9
日本ロジスティクスファンド投資法人			874	1,020	268,668		1.7
福岡リート投資法人			707	785	121,989		0.8
KDX不動産投資法人			3,917	4,246	674,264		4.3
いちごオフィスリート投資法人			1,123	1,106	92,461		0.6
大和証券オフィス投資法人			282	621	192,199		1.2
阪急阪神リート投資法人			653	724	94,482		0.6
スターツプロシード投資法人			233	263	51,469		0.3
大和ハウスリート投資法人			2,053	2,273	547,111		3.5
ジャパン・ホテル・リート投資法人			4,563	5,574	408,574		2.6
大和証券リビング投資法人			2,003	2,203	228,891		1.5
ジャパンエクセレント投資法人			1,187	1,303	162,875		1.0
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	86,341	98,625	15,474,105	99.0		
		60銘柄	59銘柄	<99.0%>			

※<>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、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、GLP投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、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、KDX不動産投資法人、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 35		百万円 -

■ 投資信託財産の構成

(2024年8月26日現在)

項 目	期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
投 資 信 託 財 産 総 額	15,474,105	98.8	15,661,410	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	187,305	1.2		
投 資 信 託 財 産 総 額	15,661,410	100.0		

Jリート・インデックス・マザーファンド

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年8月26日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	15,660,620,704円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	60,044,635
投 資 証 券 (評価額)	15,474,105,300
未 収 入 金	1,135,600
未 収 配 当 金	123,830,632
差 入 委 託 証 拠 金	1,504,537
(B) 負 債	22,399,430
未 払 解 約 金	22,399,430
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	15,638,221,274
元 本	5,989,155,612
次 期 繰 越 損 益 金	9,649,065,662
(D) 受 益 権 総 口 数	5,989,155,612口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	26,111円

※当期における期首元本額5,385,246,423円、期中追加設定元本額1,482,003,182円、期中一部解約元本額878,093,993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)	64,748,136円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	143,794,181円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	105,046,334円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,810,428,972円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	32,189,464円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,821,857円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	52,586,537円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	239,482,273円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	156,128,374円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	127,306,138円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	61,188,113円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,229,379円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	401,407,459円
日興FWS・Jリートインデックス	1,117,214,683円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	178,744,444円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	5,567,717円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	3,455,866円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	5,127,263円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	3,278,628円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	1,860,709円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	327,878円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	17,961,509円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	90,906,572円

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	98,286,773円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	38,021,942円
SMAM・世界リート・インデックスファンドV A<適格機関投資家限定>	2,641,141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>	69,740,411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>	41,912,341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>	66,750,518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2024年2月27日 至2024年8月26日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	339,648,465円
受 取 配 当 金	339,602,971
受 取 利 息	46,533
支 払 利 息	△ 1,039
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	318,405,885
売 買 益	510,977,266
売 買 損	△ 192,571,381
(C) 先 物 取 引 等 損 益	1,674,400
取 引 益	1,846,800
取 引 損	△ 172,400
(D) そ の 他 費 用 等	△ 196
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	659,728,554
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	8,039,844,796
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 1,346,637,049
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,296,129,361
(I) 合 計 (E + F + G + H)	9,649,065,662
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	9,649,065,662

※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39期（2024年2月27日から2024年8月26日まで）

信託期間	無期限（設定日：2005年6月21日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ■日本を除く世界各国の不動産投資信託（リート）などを主要投資対象とします。 ■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		
35期（2022年8月25日）	円	%			%	百万円
36期（2023年2月27日）	30,120	10.7	339.05	10.9	98.8	24,967
37期（2023年8月25日）	28,341	△5.9	319.70	△5.7	99.0	26,782
38期（2024年2月26日）	29,306	3.4	331.50	3.7	96.7	29,336
39期（2024年2月26日）	32,331	10.3	366.44	10.5	96.7	34,156
39期（2024年8月26日）	35,158	8.7	400.01	9.2	97.1	40,211

※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) 2024年2月26日	円	%			%
	32,331	—	366.44	—	96.7
2月末	32,215	△0.4	364.99	△0.4	96.5
3月末	33,461	3.5	379.63	3.6	97.4
4月末	32,907	1.8	372.85	1.8	97.8
5月末	33,431	3.4	379.20	3.5	98.7
6月末	35,028	8.3	397.92	8.6	98.5
7月末	35,535	9.9	404.02	10.3	98.3
(期末) 2024年8月26日	35,158	8.7	400.01	9.2	97.1

※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（2024年2月27日から2024年8月26日まで）

基準価額等の推移



期首	32,331円
期末	35,158円
騰落率	+8.7%

※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（2024年2月27日から2024年8月26日まで）

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

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> 米国で消費者物価指数が落ち着くなどインフレ懸念の低下を受けてFRB（米連邦準備制度理事会）による利下げ観測が強まったほか、それに追随して欧州でも利下げが観測されたこと 金融緩和によって借り入れコストの改善や、景気のソフトランディング（軟着陸）により世界的に景気が底堅く推移すると期待されたこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> 各国で強い経済指標の発表が相次ぎ、米欧の中央銀行による早期の利下げ観測が後退し、それを背景に長期金利（10年国債利回り）が上昇したこと 金融緩和の先送りから投資家のリスク回避姿勢が強まり、安全資産へ資金逃避の動きとなったこと

▶ 投資環境について（2024年2月27日から2024年8月26日まで）

グローバル・リート市場は、上昇となりました。為替市場は米ドル、ユーロなどが対円で下落しました。

グローバル・リート市場

期を通じて、グローバル・リート市場は上昇しました。

期初は米景気の堅調さを示す経済指標の発表が相次いだことを受け、FRBによる早期の利下げ観測が後退したために米長期金利が上昇し、軟調な展開となりました。4月には大幅安となる場面があったものの、米各種経済指標の鈍化から戻りに転じ、さらにFRBが9月に利下げするとの観測から期末にかけて騰勢を強め、グローバル・リート市場は期初の水準を上回りました。

為替市場

期初と比較して期末の米ドル、ユーロはともに円高となりました。

強い経済指標から米金利上昇が続くとの見方が強まる一方、日銀の金融緩和継続で日米金利差の拡大が意識され、対米ドルで円安が進行しました。6月に34年ぶりの安値水準となる160円台を付けると、日本政府・日銀による大規模介入や、米国の利下げ観測が強まったことで急速に円高に振れました。

対ユーロでも、日欧の金利差から円売りが強まり、円はユーロ導入以来の最安値を更新しました。期末にかけて欧州の追加利下げ観測から円高に振れました。

▶ ポートフォリオについて（2024年2月27日から2024年8月26日まで）

ポートフォリオの特性

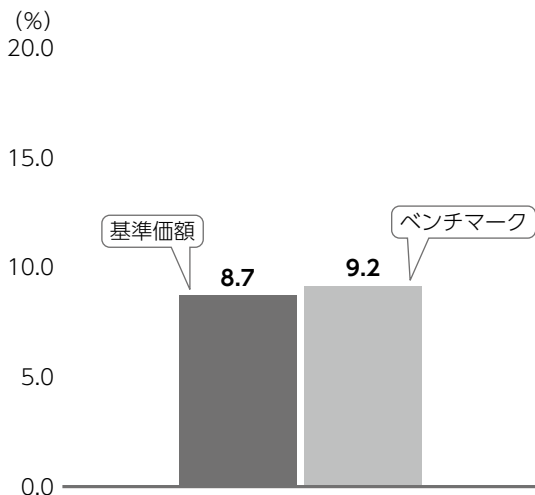
S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

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（2024年2月27日から2024年8月26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。

記載のグラフは、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+8.7%となり、ベンチマークの騰落率+9.2%を0.5%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
- ・売買コストや現地証券保管銀行の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 (2024年2月27日から2024年8月26日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売買委託手数料 (投資信託証券)	3円 (3)	0.010% (0.010)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (投資信託証券)	1 (1)	0.004 (0.004)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	7 (6) (0)	0.019 (0.019) (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 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送回数・資産の移転等に要する費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	11	0.033	

期中の平均基準価額は33,842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 (2024年2月27日から2024年8月26日まで)

投資信託証券

			買 付		売 付	
			口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外	ア メ リ カ	AGREE REALTY CORP	1,290	73	—	—
		EASTGROUP PROPERTIES INC	1,540	270	—	—
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,574	498	—	—
		SIMON PROPERTY GROUP INC	4,863	720	—	—
		BXP INC	3,226	198	—	—
		VORNADO REALTY TRUST	1,744	49	—	—
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	7,345	104	—	—
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	4,761	102	—	—
		EQUITY RESIDENTIAL	6,192	405	—	—
		EQUINIX INC	1,522	1,206	—	—
		SUN COMMUNITIES INC	1,648	198	—	—
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	5,690	257	—	—
		HOST HOTELS & RESORTS INC	11,340	215	—	—
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	5,587	205	—	—
		REALTY INCOME CORP	19,184	1,021	—	—
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,753	235	—	—
		TERRENO REALTY CORP	4,336	265	—	—
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	6,666	95	—	—
		NNN REIT INC	2,467	102	—	—
		国		INVITATION HOMES INC	8,608	301
PHYSICIANS REALTY TRUST	—			—	—	—
	(△ 42,756)			(—)	(—)	(—)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	3,218			46	—	—
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	4,173	103	—	—

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	VICI PROPERTIES INC	15,639	452	-	-
	COUSINS PROPERTIES INC	3,298	74	-	-
	AMERICOLD REALTY TRUST INC	4,500	109	-	-
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	3,995	179	-	-
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	700	80	-	-
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	6,483	174	-	-
	KIMCO REALTY CORP	5,804	104	-	-
	APARTMENT INCOME REIT CO	2,827 (△ 26,201)	108 (△ 833)	- (-)	- (-)
	GETTY REALTY CORP	3,398	96	-	-
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	1,295	66	-	-
	STAG INDUSTRIAL INC	2,664	99	-	-
	CARETRUST REIT INC	4,953	116	-	-
	PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	2,857	91	-	-
	SAFEHOLD INC	5,024	95	-	-
	NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	- (317)	- (1)	- (-)	- (-)
	AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	14,873	222	-	-
	LINEAGE INC	10,282	884	-	-
	VENTAS INC	6,475	291	-	-
	IRON MOUNTAIN INC	5,210	427	-	-
	PROLOGIS INC	14,541	1,724	-	-
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,295	401	-	-
	VERIS RESIDENTIAL INC	6,168	90	-	-
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,910	195	-	-
	SITE CENTERS CORP	- (△ 24,370)	- (-)	- (-)	- (-)
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,058	264	-	-
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,145	114	-	-
WELLTOWER INC	16,442	1,639	-	-	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	10,290 (28,817)	196 (-)	- (-)	- (-)	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,457	86	-	-	
SERVICE PROPERTIES TRUST	12,374	68	-	-	
KILROY REALTY CORP	2,690	93	-	-	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,987	186	-	-	
PUBLIC STORAGE	2,242	629	-	-	
REGENCY CENTERS CORP	3,941	237	-	-	
TANGER INC	3,523	97	-	-	
UDR INC	4,717	183	-	-	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	3,397	112	-	-	
CUBESMART	3,650	157	-	-	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	7,366	76	-	-	
DIGITAL REALTY TRUST INC	8,405	1,215	-	-	
EXTRA SPACE STORAGE INC	3,257	473	-	-	
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	DOUGLAS EMMETT INC	4,191	56	—	—
	ACADIA REALTY TRUST	5,722	97	—	—
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	3,429	72	—	—
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	7,370	77	—	—
	CHATHAM LODGING TRUST	7,270	73	—	—
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	5,644	96	—	—
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	991	97	—	—
	WP CAREY INC	2,213	127	—	—
	WHITESTONE REIT	7,557	100	—	—
	PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,024	84	—	—
	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	109,800 (—)	65 (△ 1)	(—)	(—)
	PRIME US REIT	(13,070)	(△ 0)	(—)	(—)
カ ナ ダ		□	千カナダ・ドル	□	千カナダ・ドル
	CHOICE PROPERTIES REIT	6,683	90	—	—
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,843	105	—	—
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	(△ 2,733)	(—)	(—)	(—)
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,113	81	976	75
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	6,069	104	—	—
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	115,172	375	—	—
	ARENA REIT	34,522	125	—	—
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	29,159	94	—	—
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	37,386	133	—	—
	CENTURIA CAPITAL GROUP	55,909	98	—	—
	DEXUS/AU	9,879	69	—	—
	HMC CAPITAL LTD	19,666	139	—	—
	BWP TRUST	48,858	184	—	—
	MIRVAC GROUP	66,952	145	—	—
STOCKLAND	31,925	155	—	—	
GOODMAN GROUP	25,781	856	—	—	
香 港		□	千香港・ドル	□	千香港・ドル
	CHAMPION REIT	158,000	251	—	—
	PROSPERITY REIT	134,000	183	—	—
	LINK REIT	30,800	1,114	—	—
国 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 & COMMERCIAL	(—)	(△ 4)	(—)	(—)
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	38,800 (—)	89 (△ 0)	(—)	(—)
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	54,300	118	—	—
	KEPPEL DC REIT	58,800 (—)	105 (△ 2)	(—)	(—)

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	CAPITALAND ASCENDAS REIT	72,000 (-)	191 (△ 5)	- (-)	- (-)
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	128,300 (-)	252 (△ 0)	- (-)	- (-)
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	- (-)	- (△ 9)	- (-)	- (-)
	KEPPEL REIT	- (-)	- (△ 0)	- (-)	- (-)
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	- (-)	- (△ 6)	- (-)	- (-)
	ESR-LOGOS REIT	- (-)	- (△ 1)	- (-)	- (-)
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	- (-)	- (△ 0)	- (-)	- (-)
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	- (-)	- (△ 1)	- (-)	- (-)
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	91,000 (-)	118 (△ 2)	- (-)	- (-)
	AIMS APAC REIT	- (-)	- (△ 1)	- (-)	- (-)
ニュージーランド	PRECINCT PROPERTIES GROUP	□ 52,177	千ニュージーランド・ドル 59	□ -	千ニュージーランド・ドル -
	GOODMAN PROPERTY TRUST	48,015	109	-	-
イギリス	TRITAX BIG BOX REIT PLC	□ 45,011 (52,324)	千イギリス・ポンド (72 -)	□ - (-)	千イギリス・ポンド (-)
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	23,797 (172,406)	49 (-)	- (-)	- (-)
	UNITE GROUP PLC/THE	11,844	111	-	-
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	9,814	73	-	-
	GREAT PORTLAND ESTATES -NIL	(24,969)	(-)	24,969 (-)	26 (-)
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	56,384	78	-	-
	LAND SECURITIES GROUP PLC	13,747	87	-	-
	SEGRO PLC	39,707	350	-	-
	HAMMERSON PLC	148,165	42	-	-
	BRITISH LAND CO PLC	11,991	46	-	-
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	30,284	109	-	-
	DERWENT LONDON PLC	3,462	72	-	-
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	96,759	67	-	-
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	(△117,847)	(-)	(-)	(-)
	LXI LTD	(△313,466)	(-)	(-)	(-)
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	58,281	54	-	-
REGIONAL REIT LTD	(△143,291)	(-)	(-)	(-)	
イスラエル	REIT 1 LTD	□ 6,915	千イスラエル・シェケル 104	□ -	千イスラエル・シェケル -

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	韓 国	SK REITS CO LTD	14,284 (-)	千韓国・ウォン 62,732 (△ 336)	口 - (-)	千韓国・ウォン - (-)
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	(-)	(△ 431)	(-)	(-)
		KORAMCO LIFE INFRA RE-RIGHTS	(618)	(-)	(-)	(-)
	オランダ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	937	千ユーロ 21	口 -	千ユーロ -
		MONTEA NV	503	40	-	-
	ベルギー	AEDIFICA	1,934	104	-	-
		COFINIMMO	1,034	59	-	-
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,285	63	-	-
		INTERVEST SA	-	-	4,899	101
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,265 (-)	164 (△ 44)	-	-
	フランス	ICADE	1,095	26	-	-
		GECINA SA	958	97	-	-
		KLEPIERRE	3,064 (-)	73 (△ 3)	-	-
		CARMILA	(-)	(△ 9)	-	-
		HAMBORNER REIT AG	839 (-)	5 (△ 4)	-	-
	スペイン	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	13,844 (-)	146 (△ 13)	-	-
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	7,395	40	-	-
	その他	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	5,699 (-)	39 (△ 0)	-	-
		CROMWELL REIT EUR	(-)	(△ 4)	-	-
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	674	25	-	-

※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。

■ 利害関係人との取引状況等 (2024年2月27日から2024年8月26日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2024年2月27日から2024年8月26日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2024年8月26日現在)

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		期末		
	口数	口数	評価額		組入比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)	口	口	千アメリカ・ドル	千円	%
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000	178,800	109	15,786	0.0
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900	130,900	31	4,510	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000	20,000	2	393	0.0
PRIME US REIT	130,700	143,770	25	3,653	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900	245,900	19	2,824	0.0
(アメリカ)					
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	20,329	20,329	268	38,494	0.1
LXP INDUSTRIAL TRUST	52,073	52,073	533	76,624	0.2
AGREE REALTY CORP	16,311	17,601	1,283	184,203	0.5
EASTGROUP PROPERTIES INC	7,419	8,959	1,686	242,092	0.6
AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,283	25,857	5,733	823,068	2.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	54,227	59,090	9,838	1,412,412	3.5
BXP INC	23,671	26,897	1,966	282,340	0.7
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,200	23,200	206	29,675	0.1
VORNADO REALTY TRUST	25,943	27,687	959	137,764	0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	61,807	69,152	1,217	174,723	0.4
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	49,398	54,159	1,468	210,859	0.5
URBAN EDGE PROPERTIES	20,402	20,402	420	60,423	0.2
PARAMOUNT GROUP INC	23,577	23,577	117	16,889	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	56,791	62,983	4,637	665,750	1.7
EPR PROPERTIES	12,612	12,612	600	86,165	0.2
EQUINIX INC	15,572	17,094	14,153	2,031,825	5.1
SUN COMMUNITIES INC	20,902	22,550	2,999	430,590	1.1
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	43,329	49,019	2,487	357,065	0.9
HOST HOTELS & RESORTS INC	118,744	130,084	2,264	325,129	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	53,816	59,403	2,291	328,920	0.8
REALTY INCOME CORP	138,952	158,136	9,660	1,386,865	3.4
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289	17,289	95	13,775	0.0
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,092	22,092	342	49,190	0.1
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,193	7,193	565	81,195	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,263	21,016	3,291	472,561	1.2
TERRENO REALTY CORP	13,412	17,748	1,260	180,952	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	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	37,565	44,231	735	105,597	0.3
NNN REIT INC	29,606	32,073	1,495	214,657	0.5
INVITATION HOMES INC	94,601	103,209	3,731	535,623	1.3
XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,827	17,827	245	35,266	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	42,756	—	—	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,722	35,722	541	77,692	0.2
APPLE HOSPITALITY REIT INC	37,103	40,321	584	83,933	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	14,792	14,792	259	37,310	0.1
RLJ LODGING TRUST	24,132	24,132	229	33,015	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,780	17,953	493	70,850	0.2
VICI PROPERTIES INC	172,414	188,053	6,186	888,197	2.2
COUSINS PROPERTIES INC	25,172	28,470	795	114,235	0.3
AMERICOLD REALTY TRUST INC	43,507	48,007	1,417	203,517	0.5
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	35,704	39,699	2,065	296,528	0.7
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,829	10,529	1,098	157,653	0.4
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	26,412	32,895	1,040	149,322	0.4
KIMCO REALTY CORP	112,087	117,891	2,738	393,154	1.0
APARTMENT INCOME REIT CO	23,374	—	—	—	—
GETTY REALTY CORP	6,971	10,369	327	46,964	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,613	22,908	1,292	185,514	0.5
STAG INDUSTRIAL INC	29,361	32,025	1,295	185,969	0.5
CARETRUST REIT INC	19,137	24,090	703	101,018	0.3
BROADSTONE NET LEASE INC	31,774	31,774	577	82,882	0.2
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165	2,165	39	5,659	0.0
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515	2,515	2	375	0.0
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424	1,424	20	2,935	0.0
ORION OFFICE REIT INC	8,094	8,094	33	4,740	0.0
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	19,743	22,600	823	118,260	0.3
INVENTRUST PROPERTIES CORP	11,866	11,866	340	48,855	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648	3,648	98	14,082	0.0
SAFEHOLD INC	5,574	10,598	270	38,781	0.1
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	7,663	7,980	45	6,541	0.0
PEAKSTONE REALTY TRUST	7,728	7,728	100	14,455	0.0
UNITI GROUP INC	46,029	46,029	206	29,669	0.1
NET LEASE OFFICE PROPERTY	2,275	2,275	68	9,869	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	組入比率
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	—	14,873	312	44,859	0.1
LINEAGE INC	—	10,282	882	126,677	0.3
VENTAS INC	65,757	72,232	4,303	617,822	1.5
IRON MOUNTAIN INC	47,715	52,925	5,999	861,223	2.1
PROLOGIS INC	153,045	167,586	21,595	3,100,197	7.7
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	25,540	28,835	3,494	501,713	1.2
BRANDYWINE REALTY TRUST	34,607	34,607	182	26,182	0.1
VERIS RESIDENTIAL INC	10,798	16,966	287	41,235	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	17,305	19,215	2,355	338,192	0.8
SITE CENTERS CORP	32,493	8,123	497	71,367	0.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,492	11,550	3,419	490,952	1.2
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,031	13,176	1,530	219,778	0.5
WELLTOWER INC	91,969	108,411	12,941	1,857,812	4.6
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	89,400	128,507	2,886	414,352	1.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,359	19,816	633	90,947	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,446	37,820	170	24,432	0.1
KILROY REALTY CORP	16,719	19,409	704	101,172	0.3
LTC PROPERTIES INC	7,251	7,251	262	37,630	0.1
MACERICH CO/THE	38,484	38,484	598	85,965	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31,447	34,434	2,422	347,813	0.9
COPT DEFENSE PROPERTIES	20,034	20,034	583	83,751	0.2
PUBLIC STORAGE	26,309	28,551	9,734	1,397,438	3.5
REGENCY CENTERS CORP	26,538	30,479	2,176	312,502	0.8
TANGER INC	17,266	20,789	615	88,399	0.2
SL GREEN REALTY CORP	11,643	11,643	773	111,085	0.3
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884	23,884	83	12,000	0.0
UDR INC	51,176	55,893	2,420	347,439	0.9
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	41,958	45,355	1,761	252,828	0.6
CUBESMART	36,606	40,256	2,072	297,510	0.7
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,379	39,745	414	59,511	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	50,183	58,588	8,915	1,279,969	3.2
EXTRA SPACE STORAGE INC	34,970	38,227	6,812	978,047	2.4
KITE REALTY GROUP TRUST	38,279	38,279	985	141,504	0.4
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,165	33,165	287	41,279	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	97,588	97,588	440	63,183	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	
DOUGLAS EMMETT INC	26,346	30,537	480	69,002	0.2
ACADIA REALTY TRUST	14,653	20,375	455	65,433	0.2
ALEXANDER & BALDWIN INC	12,195	12,195	236	33,928	0.1
ALEXANDER'S INC	300	300	70	10,084	0.0
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,000	10,429	277	39,885	0.1
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,429	15,799	192	27,602	0.1
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400	8,400	25	3,665	0.0
CENTERSPACE	2,600	2,600	192	27,688	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	5,557	12,827	109	15,744	0.0
CITY OFFICE REIT INC	4,603	4,603	27	3,931	0.0
CLIPPER REALTY INC	800	800	3	531	0.0
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216	3,216	61	8,864	0.0
CTO REALTY GROWTH INC	3,839	3,839	72	10,416	0.0
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	15,924	15,924	214	30,747	0.1
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276	21,276	221	31,826	0.1
EQUITY COMMONWEALTH	17,598	17,598	356	51,158	0.1
FARMLAND PARTNERS INC	7,194	7,194	73	10,513	0.0
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115	15,115	25	3,732	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368	5,368	79	11,374	0.0
GLADSTONE LAND CORP	4,464	4,464	60	8,734	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	30,518	30,518	261	37,590	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,642	12,642	118	16,969	0.0
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	36,893	42,537	855	122,803	0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274	6,274	31	4,548	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,322	5,313	661	94,929	0.2
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,122	13,122	597	85,806	0.2
NETSTREIT CORP	13,768	13,768	231	33,304	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529	3,529	161	23,132	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,538	9,538	23	3,327	0.0
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352	2,352	62	8,954	0.0
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,902	19,902	185	26,685	0.1
SAUL CENTERS INC	2,331	2,331	94	13,623	0.0
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098	14,098	97	13,944	0.0
UMH PROPERTIES INC	11,316	11,316	221	31,808	0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344	1,344	59	8,543	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	
WP CAREY INC		36,813		39,026		2,343	336,434	0.8
ELME COMMUNITIES		15,190		15,190		261	37,594	0.1
WHITESTONE REIT		4,511		12,068		161	23,215	0.1
BRT APARTMENTS CORP		500		500		9	1,323	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC		4,774		8,798		214	30,805	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,259,520		4,693,467		213,895	30,706,865	76.4
(カナダ)		口		口		千カナダ・ドル	千円	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		8,107		8,107		158	16,893	0.0
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		1,447		1,447		23	2,527	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		9,193		9,193		138	14,729	0.0
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T		6,841		6,841		22	2,414	0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT		4,345		4,345		36	3,834	0.0
PRIMARIS REIT		6,318		6,318		91	9,706	0.0
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T		3,187		3,187		57	6,078	0.0
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T		15,604		15,604		83	8,859	0.0
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		9,662		9,662		67	7,170	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT		23,858		30,541		446	47,505	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		10,639		10,639		153	16,367	0.0
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		23,474		23,474		322	34,291	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		14,775		21,618		370	39,440	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		5,260		5,260		396	42,155	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		11,198		11,198		144	15,310	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		1,557		1,557		27	2,938	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		20,754		20,754		110	11,738	0.0
SLATE GROCERY REIT-CL U		3,196		3,196		39	4,210	0.0
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		829		829		7	837	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		12,000		12,000		303	32,240	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		14,077		14,077		731	77,781	0.2
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		21,001		21,001		208	22,171	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		24,676		24,676		455	48,457	0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		5,465		2,732		53	5,658	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		4,651		4,788		405	43,142	0.1
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		8,800		14,869		263	28,028	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	270,914		287,913		5,121	544,492	1.4
		26銘柄		26銘柄			<1.4%>	

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	評 価 額		組 入 比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		口	口	千オーストラリア・ドル	千円	
SCENTRE GROUP		845,820	960,992	3,248	316,727	0.8
REGION RE LTD		191,819	191,819	423	41,336	0.1
CROMWELL PROPERTY GROUP		218,718	218,718	89	8,744	0.0
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		52,361	52,361	120	11,794	0.0
NATIONAL STORAGE REIT		208,817	208,817	496	48,460	0.1
WAYPOINT REIT		113,111	113,111	292	28,566	0.1
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		72,491	72,491	195	19,085	0.0
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		84,443	84,443	264	25,772	0.1
GDI PROPERTY GROUP		83,204	83,204	51	5,030	0.0
ARENA REIT		45,981	80,503	322	31,399	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		25,921	55,080	183	17,884	0.0
RURAL FUNDS GROUP		52,739	52,739	109	10,645	0.0
INGENIA COMMUNITIES GROUP		62,840	62,840	329	32,169	0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT		30,237	30,237	85	8,314	0.0
CHARTER HALL LONG WALE REIT		97,225	134,611	510	49,747	0.1
CENTURIA OFFICE REIT		68,559	68,559	82	8,022	0.0
CENTURIA CAPITAL GROUP		104,758	160,667	274	26,789	0.1
HOMEKO DAILY NEEDS REIT		332,002	332,002	426	41,599	0.1
DEXUS/AU		180,582	190,461	1,327	129,445	0.3
HMC CAPITAL LTD		33,678	53,344	426	41,612	0.1
HEALTHCO REIT		51,410	51,410	61	5,965	0.0
ABACUS STORAGE KING		145,482	145,482	176	17,164	0.0
BWP TRUST		66,965	115,823	420	40,996	0.1
GPT GROUP		330,937	330,937	1,585	154,571	0.4
CHARTER HALL RETAIL REIT		91,686	91,686	323	31,559	0.1
MIRVAC GROUP		634,643	701,595	1,392	135,798	0.3
STOCKLAND		384,695	416,620	2,053	200,279	0.5
ABACUS GROUP		50,980	50,980	57	5,592	0.0
GOODMAN GROUP		288,326	314,107	10,227	997,266	2.5
VICINITY CENTRES		664,812	664,812	1,429	139,375	0.3
CHARTER HALL GROUP		83,440	83,440	1,203	117,324	0.3
小 計	口 数 ・ 金 額	5,698,682	6,173,891	28,192	2,749,043	6.8
	銘 柄 数 <比 率>	31銘柄	31銘柄		< 6.8%>	
(香港)		口	口	千香港・ドル	千円	
CHAMPION REIT		277,000	435,000	778	14,342	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	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		202,000		202,000		381	7,032	0.0
PROSPERITY REIT		178,000		312,000		439	8,103	0.0
LINK REIT		419,100		449,900		15,768	290,464	0.7
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		494,000		494,000		469	8,644	0.0
FORTUNE REIT		259,000		259,000		1,015	18,701	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,829,100		2,151,900		18,853	347,289	0.9
		6銘柄		6銘柄			< 0.9% >	
(シンガポール)		口		口	千シンガポール・ドル		千円	
FRASERS LOGISTICS & COMMERC I		527,638		527,638		559	61,763	0.2
PARAGON REIT		215,200		215,200		192	21,269	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		324,500		363,300		864	95,483	0.2
FRASERS CENTREPOINT TRUST		166,800		221,100		521	57,621	0.1
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		190,000		190,000		119	13,218	0.0
KEPPEL DC REIT		200,100		258,900		543	60,039	0.1
EC WORLD REIT		52,800		52,800		14	1,632	0.0
CAPITALAND ASCENDAS REIT		582,700		654,700		1,859	205,327	0.5
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		828,408		956,708		1,999	220,806	0.5
SUNTEC REIT		416,400		416,400		503	55,639	0.1
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		558,250		558,250		742	81,991	0.2
KEPPEL REIT		363,300		363,300		321	35,505	0.1
CAPITALAND ASCOTT TRUST		428,155		428,155		383	42,316	0.1
ESR-LOGOS REIT		1,097,413		1,097,413		290	32,114	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS		159,550		159,550		144	15,945	0.0
CAPITALAND CHINA TRUST		205,700		205,700		138	15,332	0.0
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		69,800		69,800		258	28,596	0.1
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST		355,000		446,000		588	65,012	0.2
STARHILL GLOBAL REIT		195,000		195,000		95	10,551	0.0
AIMS APAC REIT		113,300		113,300		145	16,015	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		66,700		66,700		45	5,045	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		262,000		262,000		149	16,491	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	7,378,714		7,821,914		10,483	1,157,722	2.9
		22銘柄		22銘柄			< 2.9% >	
(ニュージーランド)		口		口	千ニュージーランド・ドル		千円	
KIWI PROPERTY GROUP LTD		264,918		264,918		254	22,738	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		153,482		153,482		177	15,849	0.0
PRECINCT PROPERTIES GROUP		217,149		269,326		355	31,786	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	
GOODMAN PROPERTY TRUST		163,249	211,264	449	40,233	0.1		
小計	口数・金額	798,798	898,990	1,237	110,608	0.3		
	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		<0.3%>			
(イギリス)		口	口	千イギリス・ポンド	千円			
TRITAX BIG BOX REIT PLC		322,665	420,000	684	129,836	0.3		
ASSURA PLC		472,915	472,915	200	38,141	0.1		
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		170,834	367,037	764	145,016	0.4		
UNITE GROUP PLC/THE		68,968	80,812	781	148,296	0.4		
SAFESTORE HOLDINGS PLC		31,848	41,662	367	69,732	0.2		
HOME REIT PLC		96,051	96,051	36	6,926	0.0		
PRS REIT PLC/THE		89,207	89,207	80	15,235	0.0		
URBAN LOGISTICS REIT PLC		76,400	76,400	93	17,717	0.0		
WAREHOUSE REIT PLC		72,100	72,100	62	11,835	0.0		
CLS HOLDINGS PLC		41,598	41,598	38	7,230	0.0		
HELICAL PLC		17,000	17,000	38	7,226	0.0		
LIFE SCIENCE REIT PLC		104,502	104,502	35	6,782	0.0		
TARGET HEALTHCARE REIT PLC		113,949	113,949	96	18,402	0.0		
SHAFTESBURY CAPITAL PLC		304,853	361,237	534	101,388	0.3		
LAND SECURITIES GROUP PLC		127,936	141,683	900	170,868	0.4		
SEGRO PLC		200,140	239,847	2,119	402,177	1.0		
HAMMERSON PLC		591,835	740,000	213	40,584	0.1		
BRITISH LAND CO PLC		150,571	162,562	666	126,544	0.3		
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		41,616	71,900	252	47,960	0.1		
DERWENT LONDON PLC		17,263	20,725	501	95,099	0.2		
WORKSPACE GROUP PLC		20,210	20,210	128	24,468	0.1		
BIG YELLOW GROUP PLC		35,499	35,499	458	87,037	0.2		
PICTON PROPERTY INCOME LTD		57,141	153,900	116	22,050	0.1		
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		117,847	—	—	—	—		
NEWRIVER REIT PLC		46,021	46,021	37	7,047	0.0		
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		34,770	34,770	21	4,097	0.0		
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		187,422	187,422	142	27,030	0.1		
CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE		84,958	84,958	67	12,720	0.0		
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		95,000	95,000	91	17,415	0.0		
AEW UK REIT PLC		9,000	9,000	8	1,596	0.0		
LXI LTD		313,466	—	—	—	—		
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		212,067	270,348	266	50,636	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		
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	88,651	88,651	78	14,955	0.0	
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280	53,280	29	5,571	0.0	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698	70,698	33	6,413	0.0	
BALANCED COMM PROPERTY TRUST	154,750	154,750	137	26,107	0.1	
REGIONAL REIT LTD	159,212	15,921	21	4,093	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	4,852,243 37銘柄	5,051,615 35銘柄	10,108 <4.8%>	1,918,246 <4.8%>	4.8
(イスラエル)	口	口	千イスラエル・シェケル	千円		
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	36,242	36,242	256	9,992	0.0	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	110,000	110,000	188	7,325	0.0	
REIT 1 LTD	29,102	36,017	534	20,800	0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	175,344 3銘柄	182,259 3銘柄	978 <0.1%>	38,118 <0.1%>	0.1
(韓国)	口	口	千韓国・ウォン	千円		
KORAMCO LIFE INFRA REIT	6,226	6,226	28,390	3,088	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000	24,000	119,280	12,977	0.0	
D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350	6,350	23,876	2,597	0.0	
SK REITS CO LTD	12,831	27,115	139,913	15,222	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,561	12,561	46,664	5,077	0.0	
KORAMCO LIFE INFRA RE-RIGHTS	—	618	61	6	0.0	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762	8,762	56,953	6,196	0.0	
LOTTE REIT CO LTD	20,121	20,121	79,377	8,636	0.0	
JR REIT XXVII	36,632	36,632	131,875	14,348	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	127,483 8銘柄	142,385 9銘柄	626,391 <0.2%>	68,151 <0.2%>	0.2
(ユーロ・・・アイルランド)	口	口	千ユーロ	千円		
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	62,588	62,588	55	8,974	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	62,588 1銘柄	62,588 1銘柄	55 <0.0%>	8,974 <0.0%>	0.0
(ユーロ・・・オランダ)	口	口	千ユーロ	千円		
NSI NV	2,966	2,966	58	9,393	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6,975	7,912	187	30,208	0.1	
WERELDHAVE NV	6,708	6,708	95	15,312	0.0	
VASTNED RETAIL NV	2,919	2,919	69	11,168	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	19,568 4銘柄	20,505 4銘柄	411 <0.2%>	66,082 <0.2%>	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	
(ユーロ・・・ベルギー)		口	口	千ユーロ	千円		
	MONTEA NV	2,735	3,238	262	42,215	0.1	
	RETAIL ESTATES	2,065	2,065	134	21,644	0.1	
	AEDIFICA	7,278	9,212	569	91,594	0.2	
	COFINIMMO	5,913	6,947	433	69,744	0.2	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	28,540	30,825	762	122,597	0.3	
	INTERVEST SA	4,899	—	—	—	—	
	CARE PROPERTY INVEST	5,582	5,582	81	13,083	0.0	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,846	5,846	192	30,919	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	62,858	63,715	2,437	391,799	1.0	
	銘 柄 数 <比 率>	8銘柄	7銘柄		< 1.0%>		
(ユーロ・・・フランス)		口	口	千ユーロ	千円		
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,472	18,737	1,345	216,273	0.5	
	ICADE	4,873	5,968	122	19,725	0.0	
	GECINA SA	8,447	9,405	923	148,473	0.4	
	KLEPIERRE	31,494	34,558	932	149,888	0.4	
	COVIVIO	8,887	8,887	452	72,719	0.2	
	ALTAREA	723	723	74	12,018	0.0	
	CARMILA	10,208	10,208	173	27,897	0.1	
	MERCIALYS	15,342	15,342	181	29,152	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	96,446	103,828	4,205	676,148	1.7	
	銘 柄 数 <比 率>	8銘柄	8銘柄		< 1.7%>		
(ユーロ・・・ドイツ)		口	口	千ユーロ	千円		
	HAMBORNER REIT AG	12,058	12,897	84	13,600	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	12,058	12,897	84	13,600	0.0	
	銘 柄 数 <比 率>	1銘柄	1銘柄		< 0.0%>		
(ユーロ・・・スペイン)		口	口	千ユーロ	千円		
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	57,481	71,325	788	126,816	0.3	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44,900	52,295	292	46,952	0.1	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940	12,639	101	16,336	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	109,321	136,259	1,182	190,105	0.5	
	銘 柄 数 <比 率>	3銘柄	3銘柄		< 0.5%>		
(ユーロ・・・イタリア)		口	口	千ユーロ	千円		
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	7,889	7,889	17	2,840	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	7,889	7,889	17	2,840	0.0	
	銘 柄 数 <比 率>	1銘柄	1銘柄		< 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	
(ユーロ・・・その他)			口	口	千ユーロ	千円		
CROMWELL REIT EUR		48,320		48,320	67	10,875	0.0	
SHURGARD SELF STORAGE LTD		5,082		5,756	227	36,643	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	53,402		54,076	295	47,518	0.1	
	銘 柄 数 <比 率>	2銘柄		2銘柄		< 0.1%>		
ユーロ通貨計	口 数 ・ 金 額	424,130		461,757	8,690	1,397,071	3.5	
	銘 柄 数 <比 率>	28銘柄		27銘柄		< 3.5%>		
合 計	口 数 ・ 金 額	25,814,928		27,866,091	—	39,037,609	97.1	
	銘 柄 数 <比 率>	304銘柄		302銘柄		<97.1%>		

※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。

■ 投資信託財産の構成

(2024年8月26日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円	%
	39,037,609	97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,177,797	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	40,215,407	100.0

※期末における外貨建資産（39,867,430千円）の投資信託財産総額（40,215,407千円）に対する比率は99.1%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＝143.56円、1カナダ・ドル＝106.32円、1オーストラリア・ドル＝97.51円、1香港・ドル＝18.42円、1シンガポール・ドル＝110.43円、1ニュージーランド・ドル＝89.41円、1イギリス・ポンド＝189.77円、1イスラエル・シケル＝38.942円、100韓国・ウォン＝10.88円、1ユーロ＝160.76円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年8月26日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	40,517,758,304円
コーポレート債券等	1,097,950,089
投資証券(評価額)	39,037,609,515
未収入金	305,953,637
未収配当金	76,245,063
(B) 負 債	306,000,000
未払金	306,000,000
(C) 純資産総額(A-B)	40,211,758,304
元 本	11,437,415,211
次期繰越損益金	28,774,343,093
(D) 受益権総口数	11,437,415,211口
1万口当たり基準価額(C/D)	35,158円

※当期における期首元本額10,564,713,011円、期中追加設定元本額1,246,001,931円、期中一部解約元本額373,299,731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)	9,287,763円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	14,066,046円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	8,047,360円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	8,951,181,702円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	10,866,200円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	38,740,973円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,588,464円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	167,348,435円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	112,510,735円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	94,715,195円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	132,220,140円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,485,329円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	424,622,894円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	61,517,255円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	1,112,934,229円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	154,074,613円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	3,426,503円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	1,746,424円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	1,977,991円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	1,129,822円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	633,254円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	43,351円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,108,014円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	5,711,567円

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型) 6,530,096円
 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型) 2,652,374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> 28,533,260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> 51,715,222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2024年2月27日 至2024年8月26日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	699,235,629円
受 取 配 当 金	694,759,050
受 取 利 息	4,293,890
そ の 他 収 益 金	183,190
支 払 利 息	△ 501
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,376,652,107
売 買 益	4,350,589,004
売 買 損	△ 1,973,936,897
(C) そ の 他 費 用 等	△ 7,119,124
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,068,768,612
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	23,591,623,246
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 881,122,856
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,995,074,091
(H) 合 計(D+E+F+G)	28,774,343,093
次 期 繰 越 損 益 金(H)	28,774,343,093

※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。