

日興FWS・日本株インデックス

第3期（2024年7月31日決算）運用報告書（全体版）

＜投資対象とするマザーファンドの運用報告書（全体版）の訂正のお知らせとお詫び＞

以下の投資対象とするマザーファンドの運用報告書（全体版）の財務諸表に関する注記事項におきまして、ファンド名称の相違がありました。

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

記

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

「資産、負債、元本及び基準価額の状況」に関する注記事項

第21期（2023年11月30日決算）運用報告書（全体版）P42

正	誤
<p>■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。</p> <p>（中略）</p> <p>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</p> <p><u>SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド</u>（リスク3%）＜適格機関投資家限定＞ 29,029,528円</p>	<p>■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。</p> <p>（中略）</p> <p>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</p> <p><u>三井住友・ニュー・アジア・ファンド</u>（リスク3%）＜適格機関投資家限定＞ 29,029,528円</p>

以上

日興FWS・日本株 インデックス

【運用報告書(全体版)】

(2023年8月1日から2024年7月31日まで)

第 3 期
決算日 2024年7月31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、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。

■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／国内／株式／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2021年8月3日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、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	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） 日本の株式等
当ファンドの運用方法	■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ます。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合には制限を設けません。 ■外貨建資産への投資は行いません。 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） ■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。
分配方針	■年1回（原則として毎年7月31日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 (基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)

 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)

日興FWS・日本株インデックス

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

■ 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) TOPIX (東証株価指数、配当込み)		株式組入比	株式先物比 (賃建-売建)	純資産額
	(分配額)	税分配金	期騰落率	期騰落率	期騰落率			
(設定日) 2021年8月3日	円 10,000	円 —	% —	3,065.49	% —	% —	% —	百万円 1
1期 (2022年8月1日)	10,285	0	2.9	3,172.11	3.5	98.8	1.3	2,799
2期 (2023年7月31日)	12,493	0	21.5	3,861.80	21.7	98.9	1.3	7,273
3期 (2024年7月31日)	15,353	0	22.9	4,752.72	23.1	99.0	1.1	13,567

※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。

※TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指數値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。

JPXは、TOPIXの指數値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指數値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。

JPXは、TOPIXの指數値およびTOPIXにかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIXの指數値について、何ら保証、言及をするものではありません。

JPXは、TOPIXの指數値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、TOPIXの指數値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

JPXは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。

JPXは、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指數値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、JPXは当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を負いません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	(ペ ン チ マ ー ク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率 (買建-売建)
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023年 7月31日	円 12,493	% —	% 3,861.80	% 98.9	% 1.3
8月末	12,545	0.4	3,878.51	0.4	98.9
9月末	12,609	0.9	3,898.26	0.9	98.1
10月末	12,228	△ 2.1	3,781.64	△ 2.1	97.9
11月末	12,889	3.2	3,986.65	3.2	98.4
12月末	12,859	2.9	3,977.63	3.0	98.9
2024年 1月末	13,863	11.0	4,288.36	11.0	98.8
2月末	14,545	16.4	4,499.61	16.5	98.9
3月末	15,189	21.6	4,699.20	21.7	98.2
4月末	15,050	20.5	4,656.27	20.6	98.2
5月末	15,220	21.8	4,710.15	22.0	98.0
6月末	15,439	23.6	4,778.56	23.7	98.5
(期 末) 2024年 7月31日	15,353	22.9	4,752.72	23.1	99.0
					1.1

※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8月1日から2024年7月31日まで)

基準価額等の推移



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

期 首 12,493円

期 末 15,353円
(既払分配金0円(税引前))

騰 落 率 +22.9%
(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、TOPIX(東証株価指数、配当込み)です。

※TOPIXの指値およびTOPIXにかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指値の算出、指値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。

JPXは、TOPIXの指値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

JPXは、TOPIXの指値およびTOPIXにかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIXの指値について、何ら保証、言及をするものではありません。

JPXは、TOPIXの指値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、TOPIXの指値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

日興FWS・日本株インデックス

JPXは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
JPXは、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数值を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
以上の項目に限らず、JPXは当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

基準価額の主な変動要因(2023年8月1日から2024年7月31日まで)

マザーファンドへの投資を通じて、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することにより、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。

上昇要因

- 米追加利上げ観測が大きく後退し、世界的な株高となったこと
- 日銀の大規模金融緩和策の維持により為替相場が円安傾向となったこと

下落要因

- 日銀による為替介入により円高が急激に進行したこと

投資環境について(2023年8月1日から2024年7月31日まで)

国内株式市場は上昇しました。

期初は、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ると、米ドル高・円安の流れが一段進み、上昇しました。

秋以降は、米国においてFOMC(米連邦公開市場委員会)や景気指標発表を背景に長期金利が上下に大幅変動したことや、中東での地政学リスクの台頭など不透明要因が加わり、上値を抑えられる展開となりました。

年が明けると、米国株高、米ドル高・円安が進行したことに加え、日本企業の持続的な業績改善も好感され、日本株も上昇基調となりました。日

銀の金融緩和策でマイナス金利解除が発表されたものの、緩和的な姿勢は継続されるとの見通しから、米ドル高・円安が一段と進行し上昇幅を拡大しました。

2024年4月になると、日米の金融政策修正への警戒、中東情勢の緊迫化、国内企業の慎重な業績見通しにより上値の重い展開が続きましたが、米ドル高・円安の一段の進行などから上昇しました。しかし、期末には日銀による為替介入により円高が急激に進行し、値を下げました。

ポートフォリオについて(2023年8月1日から2024年7月31日まで)

当ファンド

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)の組入比率を高位に保ちました。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

●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。

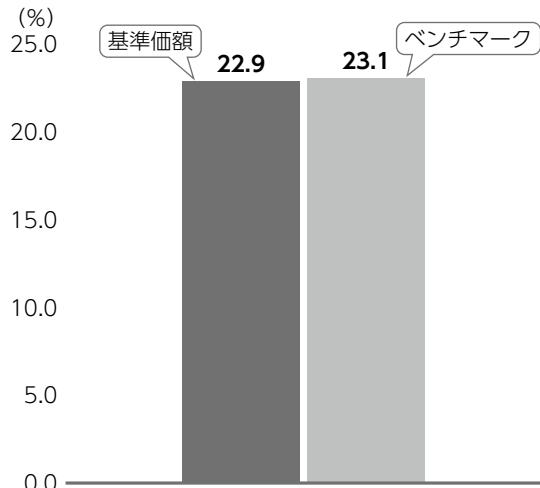
●ポートフォリオの特性

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(2023年8月1日から2024年7月31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、TOKYO STOCK INDEX (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。

※基準価額は分配金再投資ベース

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+22.9% (分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+23.1%を0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 信託報酬等のコスト負担が日々生じたこと

分配金について(2023年8月1日から2024年7月31日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第3期
当期分配金	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	5,352

※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、当ファンドの收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、見送りといたします。

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、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)の組入比率を高位に保ちます。

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)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。

3 お知らせ

約款変更について

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。

日興FWS・日本株インデックス

1万口当たりの費用明細(2023年8月1日から2024年7月31日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	17円	0.121%	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13,848円です。〕
(投信会社)	(9)	(0.066)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(5)	(0.033)	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	0	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
(株式)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) 有価証券取引税	-	-	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)	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	1	0.006	その他費用=期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送回 金・資産の移転等に要する費用 監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用 その他の信託事務の処理等に要するその他費用
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他の)	(0)	(0.000)	
合計	18	0.128	

※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。

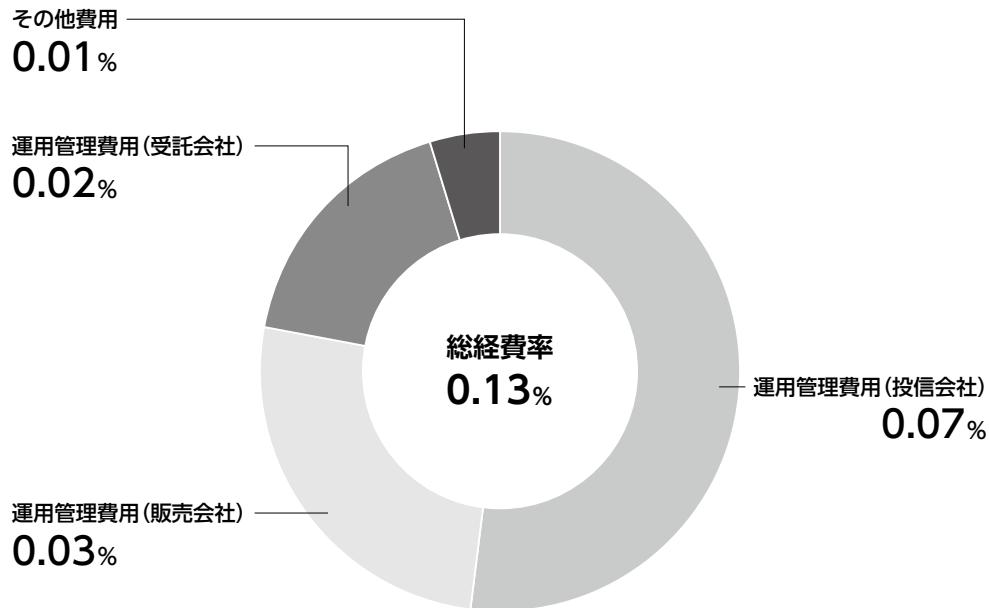
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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0.13%です。

日興FWS・日本株インデックス

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2023年8月1日から2024年7月31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
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	千口 1,251,660	千円 5,623,243	千口 325,709	千円 1,351,542

■ 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8月1日から2024年7月31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）
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	35,630,038千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	305,397,106千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.12

※(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8月1日から2024年7月31日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

日興FWS・日本株インデックス

当期中における利害関係人との取引等はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株 式	百万円 26,511	百万円 198	% 0.7	百万円 9,121	百万円 179	% 2.0

※平均保有割合 3.2%

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

日興FWS・日本株インデックス

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

種類	買付額	売付額	期末保有額
株式	百万円 286	百万円 65	百万円 6,508

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8月1日から2024年7月31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7月31日現在）

親投資信託残高

種類	期首(前期末)	期末	
	口数	口数	評価額
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	千口 1,797,110	千口 2,723,061	千円 13,574,735

※国内株式インデックス・マザーファンド（B号）の期末の受益権総口数は69,013,827,909口です。

■ 投資信託財産の構成

(2024年7月31日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	千円 13,574,735	% 99.9
コール・ローン等、その他	11,618	0.1
投資信託財産総額	13,586,353	100.0

日興FWS・日本株インデックス

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年7月31日現在)

項目	期末
(A) 資産	13,586,353,433円
コール・ローン等	11,618,134
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	13,574,735,299
(B) 負債	18,958,745
未払解約金	11,586,356
未払信託報酬	7,051,936
その他未払費用	320,453
(C) 純資産総額(A-B)	13,567,394,688
元本	8,836,978,562
次期繰越損益金	4,730,416,126
(D) 受益権総口数	8,836,978,562口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,353円

※当期における期首元本額5,821,638,664円、期中追加設定元本額4,672,800,551円、期中一部解約元本額1,657,460,653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8月1日 至2024年7月31日)

項目	当期
(A) 配当等収益	438円
受取利息	1,482
支払利息	△ 1,044
(B) 有価証券売買損益	1,936,123,677
売買益	2,028,865,527
売買損	△ 92,741,850
(C) 信託報酬等	△ 12,352,568
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,923,771,547
(E) 前期繰越損益金	895,106,717
(F) 追加信託差損益金	1,911,537,862
(配当等相当額)	(974,237,970)
(売買損益相当額)	(937,299,892)
(G) 合計(D+E+F)	4,730,416,126
次期繰越損益金(G)	4,730,416,126
追加信託差損益金	1,911,537,862
(配当等相当額)	(977,855,356)
(売買損益相当額)	(933,682,506)
分配準備積立金	2,818,878,264

※有価証券売買損益は期末の評価換算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	221,015,978円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,702,755,569
(c) 収益調整金	1,911,537,862
(d) 分配準備積立金	895,106,717
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	4,730,416,126
1万口当たり当期分配対象額	5,352.98
(f) 分配金	0
1万口当たり分配金	0

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)

当期
0円

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

国内株式インデックス・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	株式先物率 (買建-売建)	純資産額
		期騰落率	中騰落率			
17期（2019年12月2日）	円 27,359	% 5.5	% 2,611.46	% 5.5	% 97.7	% 2.3 百万円 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	(ペ ン チ マ ー ク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率 (買建-売建)
		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
2023年1月末	33,956	△ 0.3	3,238.48	△ 0.3	98.9
2月末	34,276	0.6	3,269.12	0.6	99.0
3月末	34,858	2.3	3,324.74	2.3	97.6
4月末	35,797	5.1	3,414.45	5.1	97.8
5月末	37,089	8.8	3,537.93	8.9	98.1
6月末	39,894	17.1	3,805.00	17.1	98.4
7月末	40,492	18.8	3,861.80	18.8	98.9
8月末	40,665	19.3	3,878.51	19.4	98.9
9月末	40,879	20.0	3,898.26	20.0	98.1
10月末	39,655	16.4	3,781.64	16.4	97.8
(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



※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、TOP INDEX（東証株価指数、配当込み）です。

※指標の著作権、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、TOP INDEX（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、TOP INDEX先物取引を利用しました。

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ・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	<ul style="list-style-type: none"> ・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F R B（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T O P I Xはバブル後の高値を更新しました。

期末には、F O M C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つ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

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

ポートフォリオの特性

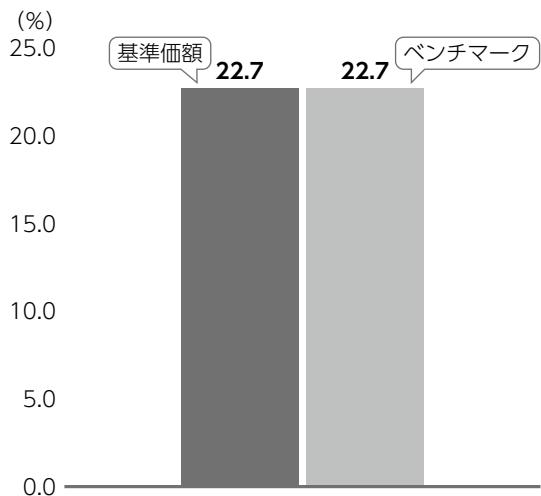
T O P I X（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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出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T O P I X（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%を追隨しました。

2 今後の運用方針

T O P I X（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。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T O P I X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	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
株式	百万円 26,323	百万円 9,992	% 38.0	百万円 11,231	百万円 2,481	% 22.1
株式先物取引	49,745	696	1.4	50,698	711	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。

■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	評 価 額
	千株	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
雪国まいかけ	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
三井松島ホールディングス	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
日本アクリア	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
錢高組	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	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
東京エニシス	8.5	8.7	8,395
トーエニック	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
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	
大氣社	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	
インフロニア・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%）				
ニップン	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	
D M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	
龜田製菓	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	
プリマハム	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 F o o d s	8.4	8.9	28,524	

銘柄	期首(前期末)	期末		
		株数	株数	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 ポトラーズ	58.9	63.6	128,821	
ジャパンホールディングス	—	1.7	6,579	
ライフドリンク カンパニー	52.5	57.1	265,400	
サントリ食品インターナショナル	4.2	4.5	26,910	
ダイドーグループホールディングス	27.9	27.5	123,612	
伊藤園	8.5	8.4	17,371	
キーコーヒー	10.4	11.3	47,290	
日清オイリオグループ	17.7	18.9	43,885	
不二製油グループ本社	2.9	1.8	6,408	
かどや製油	7.8	8.3	16,375	
J一オイルミルズ	49.5	53.7	486,790	
キッコーマン	183.4	195.8	1,081,990	
味の素	3.5	4.7	9,832	
ブルドックソース	40.2	43.6	112,488	
キューピー	22.9	24.8	80,079	
ハウス食品グループ本社	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	
イー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	
ユーベレナ	49.3	51.5	38,419	
紀文食品	6.9	7.1	8,179	
ピックル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
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	
木ギメディカル	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	
ゴールドワイン	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	
トモク	5.4	5.4	11,739	
ザ・パック	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
ティカ	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	
東亞合成	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	
高圧ガス工業	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 ネオカム	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
群栄化学工業	2.2	2.1	6,478	
ミライアル	3.6	2.7	4,101	
ダイキヨーニシカワ	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	
A D E K A	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	
D I C	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 T O K A	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	
ボーラ・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	
I - 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
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	
J C U	8.6	9.2	36,340	
新田ゼラチン	5.9	6	4,704	
O A T 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	
日東電工	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	
J S P	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	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	144	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	
J C R フーマ	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	
そせいグループ	—	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%）				
日本コーカス工業	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	
E N E O S 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	
T O Y O T I R E	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	評価額
A G C	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	
アジアバ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	
T O T O	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	
M A R U W A	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	
J F E 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	
東京鐵鋼	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	
中部鋼鉄	—	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
日本金属	—	3.6	3,286	
大平洋金属	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	
エンピプロ・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	
U A C J	11.1	12	41,580	
C K 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	
S W C C	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	
リヨービ	8.9	9.3	27,109	
アーレスティ	—	8.5	6,944	
A R E ホールディングス	31.7	34.6	66,051	
金属製品（0.5%）				
稻葉製作所	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	
S U M C O	149.4	151.1	334,913	
川田テクノロジーズ	2.2	2.3	16,100	
R S 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	
文化シヤッター	22.6	24	33,120	

銘柄	期首(前期末)	期末		
		株数	株数	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	
高周波熱鍊	14.5	14	14,042	
東京製綱	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	
F U J I	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	
D M G 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N P R	—	7	13,720	
島精機製作所	12.3	13.5	20,709	
オptron	11.6	13.7	22,289	
N C 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
イワキ	5.7	6.3	12,959	
フリュー	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	
ナブテスコ	48.4	52.1	144,186	
三井海洋開発	9.9	10.6	20,214	
レオン自動機	8.7	9.1	14,214	
S M C	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・ピー機械	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	
オカダアイヨン	1.4	—	—	
ワイエイシホールディングス	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	
ローツェ	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	
濱谷工業	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
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	
タダメ	41.4	47.5	54,838	
フジテック	28.2	24.6	84,353	
C K D	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	
ユーシン精機	—	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
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	
キツツ	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	
I H I	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	
プラザー工業	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	
P H C 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	
J V C 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	
I - P E X	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
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	
ジース・ユア 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	
セイコーワープソン	102.2	106.7	234,526	
ワコム	61.4	63.4	43,619	
アルパック	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	
アルプラスアルパイン	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	
マイコー	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	株 数	株 数	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			
エスペック	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			
O B A R A G R O U P	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			
オプテックスグループ	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			
ヘリオス 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	株 数	株 数	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			
キヤノン電子	8.7	9.1	17,936			
キヤノン	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			
日本車輪製造	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			
武藏精密工業	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			
トピー工業	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
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	
ティ・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	
インターラクション	5.1	4.5	4,572	
オーパル	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
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	
セイコーホールディングス	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	
バラマ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	
フランスペ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
ナカバヤシ	3.3	—	—	—
グローブライド	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	
ハマキヨウレックス	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
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	
アルプラス物流	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丸とホールディングス	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	
S Gホールディングス	145.4	145.5	311,006	
NIPPON EXPRESS	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	
N S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	
バスコ	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	
滋澤倉庫	3.5	3.3	9,348	
東陽倉庫	27.4	3.7	5,616	
日本トランシスティ	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		
		株 数	株 数	評 価 額
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	
ポールトゥイ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	—	—	
メディアドウ	3.5	3.7	5,609	
じげん	25.2	24.9	13,396	
ブイキューブ	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		
		株 数	株 数	評 価 額
CARTA HOLDINGS	4.2	4.4	5,772	
オプティム	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	
マークライズ	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・インフォメーション・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	
オープンドア	5.7	6.3	4,554	
アカツキ	4.2	4.4	10,172	
U b i c o m 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	株数	株数	評価額
電算システムホールディングス	4	4.2	11,671			
APP IER 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			
インテー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			
シンプルクス・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			
S a n s a n	29	27.3	42,205			
ギフティ	8.5	7.6	14,432			
メドレー	—	11.1	49,117			
ベース	2.6	3.1	10,323			
J M D C	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			
T D C ソフト	6.7	7.2	15,112			
L I N E ヤフー	1,087.2	1,160	499,496			
トレンドマイクロ	44.1	39.1	293,797			
I D 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			
C A C Holdings	4.9	5.3	9,476			
S B 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	株数	株数	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			
A C C E S S	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			
W O W O W	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	—	—			
A N Y C O L O R	—	3	11,550			
I M A G I C A G R O U P	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			
マーべラス	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			
T B S 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J S A T 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B S 放送	—	6.5	5,765			
ビジョン	10.5	12.6	14,641			
U S E N - N E X T H O L D I N G S	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			
K D D I	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			
G M O 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			
K A D O K A W A	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	株 数	株 数	評 価 額
東映	2.1	2.3	40,756			
N T Tデータグループ	238.5	222.5	399,832			
ピー・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			
カプコン	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			
N S W	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			
トーメンデバイス	1.3	1.4	7,420			
東京エレクトロン デバイス	3	9.6	46,800			
円谷フィール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			
バイタルケーエスケー・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・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	株 数	株 数	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
ピューティガレージ	1.8			3		7,560
ワイン・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
佐鳥電機	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
ハピネット	7.2			7.9		20,358
日本ライフライン	24.3			25.7		29,914
タカショーワークス	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
シーカス	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	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	
〇UG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	
キヤノ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	
稻畑産業	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	
リヨーサン	8.8	9.3	45,988	
新光商事	12.1	12.3	14,858	
トーホー	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	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	
PALTAC	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	
ト拉斯コ中山	16.8	18.2	43,261	
オートバックスセブン	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	
パ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
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	
アルペン	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	
ピックカメラ	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	
アーフラント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	
マツキヨコカラ&カンパニー	48.8	158.7	405,240	
ブロンコビリー	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	—	—	
B E E N O S	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
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	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	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	
VT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	
ハイディ日高	12.1	13.1	36,011	
コロワイド	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	
ヨンドシホールディングス	7.6	7.7	15,053	
木曽路	12.9	12.8	31,884	
SRS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
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	
M r M a x H D	12.2	13.2	8,289	
A O K I 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	
O l y m p i c 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	
ケー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
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	
ペルーナ	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	
しづ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	
コンコレディア・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	
S B I 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	評 価 額
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%）				
F P G	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	
S B I 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	評 価 額
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	
東洋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	
ブレミアグループ	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		
		株数	株数	評価額
オリックス	499.8	501.5	1,353,297	
三菱H C 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	
アサックス	—	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	
S R E 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	
J P M C	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	
オーブンハウスグループ	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		
		株数	株数	評価額
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	
F J ケ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	—	—	
日本空港ビルディング	26.7	28.8	187,200	
サービス業 (4.8%)				
日本工営	5.8	—	—	
L I F U L L	34.3	32.4	6,350	
M I X I	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	
U T 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	
オーブンアップグループ	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	
バ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	—	—	
N J S	—	1.5	4,240	
綜合警備保障	29.3	150.3	128,777	
カカクコム	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
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キューシステム	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	
ブレスステージ・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	
ぴあ	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	—	—	
リゾー教育	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
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	
SBグローバルセットマネジメント	15.2	15.8	8,800	
ティー・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	
I B J	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	
ライオンエクスプレスホールディングス	4.2	4.2	4,271	
E R I ホールディングス	3.8	1.9	3,273	
アビスト	—	0.5	1,520	
シグマクシス・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	
ペイカレント・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スホールディングス	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		
		株 数	株 数	評 価 額
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・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	
R P A 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	
L I T A L I C O	6.2	6.7	14,344	
リログループ	44	45.7	70,972	
東祥	7	6.9	5,630	
I D & E ホールディングス	—	5.1	16,702	
ビーウィズ	3.3	2.4	5,450	
T R E 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	
N I S S O 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	
燐ホールディングス	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		
		株 数	株 数	評 価 額
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	
K N T - C T 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	
マイティックグループホールディングス	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	
ペ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		千株	千株	千円
株 数・金 額		88,126.6	123,739.3	277,901,462
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
T O P I X	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
株 式		千円	%
コ ー ル・ロ ー ン 等、そ の 他		277,901,462	97.8
投 資 信 託 財 産 総 額		6,396,437	2.2
		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算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。

■ 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D S・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・D C年金バランス30（債券重点型）	1,001,422,929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）	8,796,845円
三井住友・D C年金バランス50（標準型）	4,466,421,362円	SMAM・国内株式バッシップ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,397,731,905円
三井住友・D C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・D C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VA 2 5 <適格機関投資家専用>	965,486,618円
三井住友・D C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VA 3 7 5 <適格機関投資家専用>	1,166,398,533円
三井住友・D C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VA 5 0 <適格機関投資家専用>	4,510,477,578円
三井住友・D C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VL 3 0 <適格機関投資家限定>	29,416,152円
三井住友・D C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VL 5 0 <適格機関投資家限定>	108,603,049円
三井住友・D C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VL A 7 5 <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・インデックス・バランスVA 2 5 <適格機関投資家専用>	195,641,630円
三井住友・D C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VA 5 0 <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（安定型）	115,624,640円	SMAM・バランスファンドVA 4 0 <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（安定成長型）	168,156,238円	SMAM・バランスファンドVA A 3 5 <適格機関投資家専用>	1,267,607,584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VA株4 0 T <適格機関投資家限定>	314,855円
イオン・バランス戦略ファンド	37,149,436円	SMAM・グローバルバランス4 0 VA <適格機関投資家限定>	27,021,199円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2050	50,643,471円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 0 A <適格機関投資家専用>	29,338,861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VA 3 5 A <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（2やや安定型）	197,543,121円	SMAM・アセットバランスファンドVA 5 0 A <適格機関投資家専用>	14,447,235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VA 2 0 L <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（4やや成長型）	448,368,315円	SMAM・アセットバランスファンドVA 2 5 L <適格機関投資家専用>	173,003,538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VA 2 0 A <適格機関投資家専用>	37,568,256円
三井住友・D C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VA 3 5 A <適格機関投資家専用>	32,445,682円
三井住友D S・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VA 5 0 A <適格機関投資家専用>	6,832,341円
三井住友D S・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VA 3 0 L 2 <適格機関投資家専用>	30,702,488円
三井住友D S・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VA 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	411,103,933円
三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）	240,914,837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
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060	5,981,135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
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（債券重視型）VA <適格機関投資家限定>	65,272,266円
三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド	68,065,303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D S・D C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 2 <適格機関投資家限定>	29,597,543円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2040	482,039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D S・D Cターゲットイヤーファンド2045	427,244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D S・D C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・オープン<適格機関投資家限定>	45,469,182円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2065	230,889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D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	554,713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D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	7,852,953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
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）	34,809,759円		

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。