

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
■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。	■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。
(中略)	(中略)
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	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
<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	<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

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

■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T O P I X（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T O P I X（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資し、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。）

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T O P I X（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。



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)

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) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株式組入 比	株式先物 比率 (買建-売建)	純 資 産 額 総
	(分配落)	税 込 分 配 金	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。
※T O P I Xの指数値およびT O P I Xにかかる標章または商標は、株式会社 J P X総研または株式会社 J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利・ノウハウおよびT O P I Xにかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。
J P Xは、T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の停止またはT O P I X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。
J P Xは、T O P I Xの指数値およびT O P I X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T O P I Xの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
J P Xは、T O P I Xの指数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、J P Xは、T O P I Xの指数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、J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。
J P X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。
J P Xは、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、T O P I Xの指数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、J P X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。

■ 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		
(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	1.2
9 月末	12,609	0.9	3,898.26	0.9	98.1	1.9
10月末	12,228	△ 2.1	3,781.64	△ 2.1	97.9	2.2
11月末	12,889	3.2	3,986.65	3.2	98.4	1.6
12月末	12,859	2.9	3,977.63	3.0	98.9	1.1
2024年 1 月末	13,863	11.0	4,288.36	11.0	98.8	1.3
2 月末	14,545	16.4	4,499.61	16.5	98.9	1.0
3 月末	15,189	21.6	4,699.20	21.7	98.2	1.8
4 月末	15,050	20.5	4,656.27	20.6	98.2	1.9
5 月末	15,220	21.8	4,710.15	22.0	98.0	2.0
6 月末	15,439	23.6	4,778.56	23.7	98.5	1.6
(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、指数値の公表、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の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数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の指数値および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の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

JPXは、TOPIXの指数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の指数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。

J P X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。
J P Xは、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、T O P I Xの指数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、J P X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T O P I X(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、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。

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、上値を抑えられた展開となりました。

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。

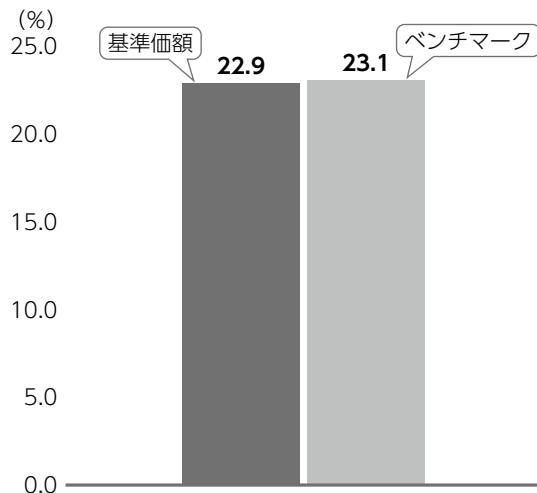
●ポートフォリオの特性

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、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。

※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

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、見送りといたしました。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。
 ※「対基準価額比率」は、「当期分配金」(税引前)の期末基準価額(分配金(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、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。

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) <div> <div>期中の平均基準価額は13,848円です。</div> <div> 投信会社:ファンド運用の指図等の対価 販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価 </div> </div>
(投 信 会 社)	(9)	(0.066)	
(販 売 会 社)	(5)	(0.033)	
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	
(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: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)	(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。

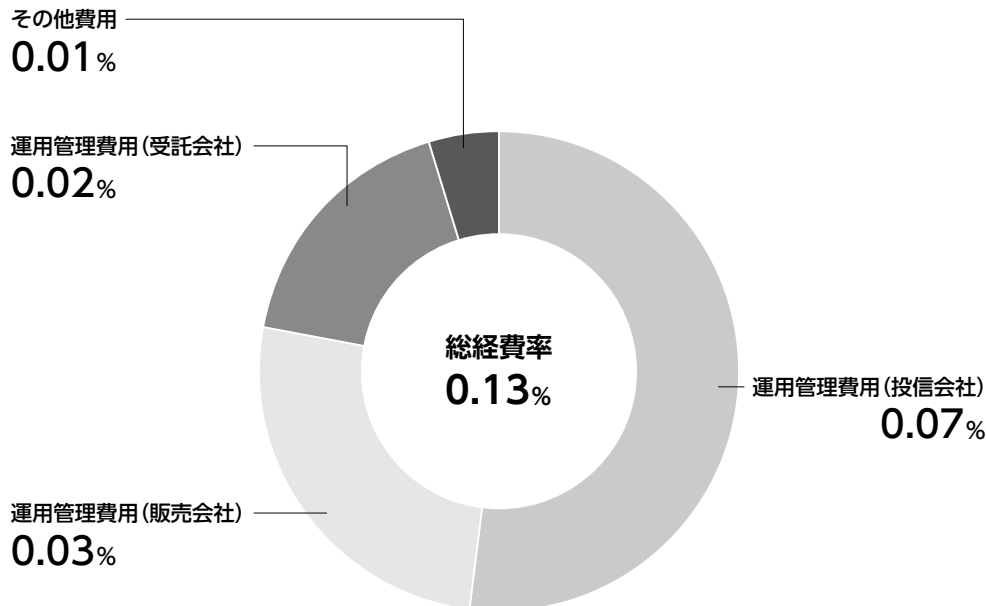
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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。

■ 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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円 26, 511	百万円 198	% 0. 7	百万円 9, 121	百万円 179	% 2. 0
株 式						

※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ビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	百万円 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

■ 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	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T O P I X（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、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。

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) 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)	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	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		
(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

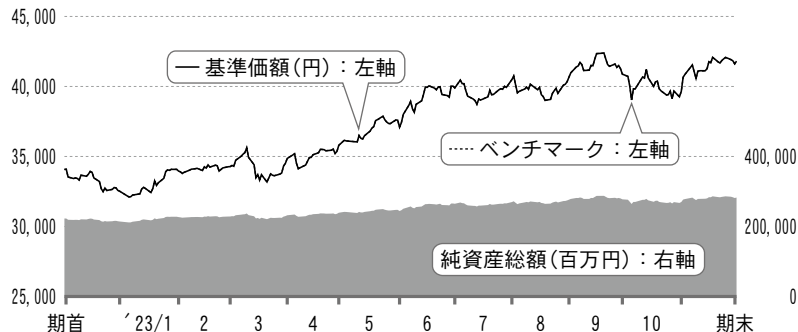
※騰落率は期首比です。

※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



※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	34,074円
期 末	41,803円
騰 落 率	+22.7%

※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	<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

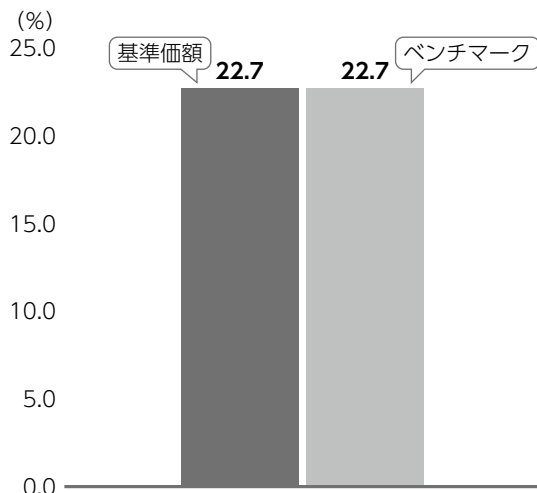
ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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	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。

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
	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
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
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
ダイダシ	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・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 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 ボトラーズ	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	—		1.7		6,579
サ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
イトアイトホールディングス	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
ビ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) 株数	期末 株数	期末 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
小松マテール	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) 株数	期末 株数	期末 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
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
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
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
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
エフビコ	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	
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	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	
TOYO	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
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
FUJI	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
イフキ	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
P E G A S U S	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・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
T O W A	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
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
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
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
S A N K Y O	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
J U K I	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		—		—
T P R	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
N T N	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
T H K	44.4		47.8		141,177
ユージン精機	—		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
日本ビラー工業	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
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
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
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	
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	
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	
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	
SCREEN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	
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	
バイ・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	
ノーリツ銅機	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	
パ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	
前田工機	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	
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	
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
	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
エーアイテイー	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
エニゴモ	11.2		12.7		4,864
コロブラ	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
	株	数	株	数	評価額
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
オーブンドア	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
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		
イーンソル	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		
ギフト	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 H o l d i n g s	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
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		
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	—	—		
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		
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		
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		
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		
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
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
DT 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
SCSK	61.9		58		157,992
NSW	3.3		3.3		9,685
アイネス	6		6.3		10,495
TKC	13.2		12.7		44,958
富士ソフト	8.5		17.2		103,028
NSD	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
JBC 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
大光	—		8.9		5,678
TOKAI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	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
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	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
立花エレクトック	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Wisemettac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
キャンドウ	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	数	株数	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	—	—		
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	数	株数	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		
カノ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		
VTH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		
ヨンドシーホールディングス	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	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	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) 株数	期 株数	末 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) 株数	期 株数	末 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
	株数	株数	評価額
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
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
スタートコーポレーション	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	—	—
日本空港ビルディング	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) 株数	期 株数	期末 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
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) 株数	期 株数	期末 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
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・ティエ・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		
カープ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		
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
	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		
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	千株		千株	千円	
	株数・金額	88,126.6	123,739.3	277,901.462	
合 計	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	T O P I X	百万円 4,633	百万円 —

■ 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 277,901,462	97.8	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,396,437	2.2	
投 資 信 託 財 産 総 額	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）	1,001,422,929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V L 30＜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V L 50＜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V L 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40 T＜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40 VA＜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VA20 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（2やや安定型）	197,543,121円	SMAM・アセットバランスファンドVA35 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（3バランス型）	777,703,738円	SMAM・アセットバランスファンドVA50 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（4やや成長型）	448,368,315円	SMAM・アセットバランスファンドVA20 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（5成長重視型）	525,557,954円	SMAM・アセットバランスファンドVA25 L＜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VA20 A2＜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VA35 A2＜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VA50 A2＜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VA30 L2＜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VA25 L2＜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。