

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド  
第12期（2023年11月30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。<br>(中略)<br>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<br><u>SMDAM・年金Wリスクコントロールファン</u><br><u>ド（リスク3%）&lt;適格機関投資家限定&gt;</u><br>29,029,528円 | ■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。<br>(中略)<br>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<br><u>三井住友・ニュー・アジア・ファンド（リスク</u><br><u>3%）&lt;適格機関投資家限定&gt;</u><br>29,029,528円 |

以上

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|            |   |
|------------|---|
| 商品分類       | 追加型投信／国内／株式／インデックス型   |
| 信託期間       | 無期限（設定日：2011年12月9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。  |
| 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。<br>国内株式インデックス・マザーファンド（B号）<br>日本の取引所に上場している株式   |
| 当ファンドの運用方法 | ■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。<br>■株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。  |
| 組入制限       | 当ファンド<br>■株式への実質投資割合には、制限を設けません。<br>■外貨建資産への投資は行いません。<br>国内株式インデックス・マザーファンド（B号）<br>■株式への投資割合には、制限を設けません。<br>■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11月30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。<br>■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。<br>■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。<br>※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。<br>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・ DCつみたてNISA・日本株 インデックスファンド 【運用報告書(全体版)】

(2023年12月1日から2024年12月2日まで)

第 **13** 期  
決算日 2024年12月2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。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

## 三井住友DSアセットマネジメント

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

### ■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

### ■当運用報告書についてのお問い合わせ

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

## 三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

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

### 最近5期の運用実績

| 決算期               | 基準価額       |         |                | ベンチマーク<br>TOPIX<br>(東証株価指数、配当込み) |          | 株式組入率<br>比 | 株式先物率<br>比<br>(買建-売建) | 純資産額    |
|-------------------|------------|---------|----------------|----------------------------------|----------|------------|-----------------------|---------|
|                   | (分配落)<br>円 | 税金<br>円 | 期中<br>騰落率<br>% | 騰落率<br>%                         | 騰落率<br>% |            |                       |         |
| 9期 (2020年11月30日)  | 27,977     | 0       | 4.7            | 2,738.72                         | 4.9      | 97.8       | 2.0                   | 42,720  |
| 10期 (2021年11月30日) | 31,333     | 0       | 12.0           | 3,073.26                         | 12.2     | 97.8       | 2.4                   | 58,388  |
| 11期 (2022年11月30日) | 33,080     | 0       | 5.6            | 3,249.61                         | 5.7      | 98.0       | 2.0                   | 74,957  |
| 12期 (2023年11月30日) | 40,507     | 0       | 22.5           | 3,986.65                         | 22.7     | 98.4       | 1.6                   | 109,683 |
| 13期 (2024年12月2日)  | 47,323     | 0       | 16.8           | 4,664.51                         | 17.0     | 98.0       | 2.1                   | 146,765 |

※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に関する知的財産権その他一切の権利は、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。）に帰属します。JPXは、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標準または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、JPXは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

### 当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日                 | 基準価額        |           | ベンチマーク<br>TOPIX<br>(東証株価指数、配当込み) |           | 株式組入率<br>比 | 株式先物率<br>比<br>(買建-売建) |
|---------------------|-------------|-----------|----------------------------------|-----------|------------|-----------------------|
|                     | 騰落率         | 騰落率       | 騰落率                              | 騰落率       |            |                       |
| (期首)<br>2023年11月30日 | 円<br>40,507 | %<br>-    | 円<br>3,986.65                    | %<br>-    | %<br>98.4  | %<br>1.6              |
| 12月末                | 40,415      | △ 0.2     | 3,977.63                         | △ 0.2     | 98.9       | 1.1                   |
| 2024年1月末            | 43,569      | 7.6       | 4,288.36                         | 7.6       | 98.8       | 1.3                   |
| 2月末                 | 45,711      | 12.8      | 4,499.61                         | 12.9      | 99.0       | 1.0                   |
| 3月末                 | 47,735      | 17.8      | 4,699.20                         | 17.9      | 98.3       | 1.8                   |
| 4月末                 | 47,297      | 16.8      | 4,656.27                         | 16.8      | 98.2       | 1.9                   |
| 5月末                 | 47,831      | 18.1      | 4,710.15                         | 18.1      | 98.1       | 2.0                   |
| 6月末                 | 48,518      | 19.8      | 4,778.56                         | 19.9      | 98.4       | 1.6                   |
| 7月末                 | 48,247      | 19.1      | 4,752.72                         | 19.2      | 99.0       | 1.1                   |
| 8月末                 | 46,842      | 15.6      | 4,615.06                         | 15.8      | 98.7       | 1.3                   |
| 9月末                 | 46,120      | 13.9      | 4,544.38                         | 14.0      | 98.2       | 2.0                   |
| 10月末                | 46,983      | 16.0      | 4,629.83                         | 16.1      | 98.0       | 2.1                   |
| 11月末                | 46,731      | 15.4      | 4,606.07                         | 15.5      | 98.0       | 2.1                   |
| (期末)<br>2024年12月2日  | 円<br>47,323 | %<br>16.8 | 円<br>4,664.51                    | %<br>17.0 | %<br>98.0  | %<br>2.1              |

※騰落率は期首比です。

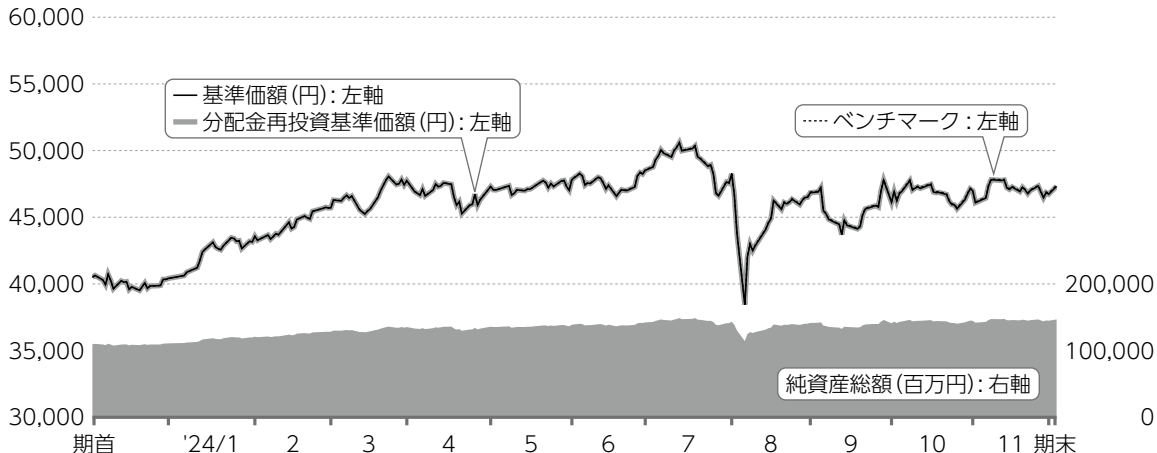
※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※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12月1日から2024年12月2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  | 40,507円                   |
| 期末  | 47,323円<br>(既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | +16.8%<br>(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に関する知的財産権その他一切の権利は、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。)に帰属します。JPXは、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、JPXは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

### 基準価額の主な変動要因(2023年12月1日から2024年12月2日まで)

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

#### 上昇要因

- 日銀が追加利上げに慎重な姿勢を示し、株式市場が上昇したこと
- 米国株高、米ドル高・円安が進行し、株価の押し上げ要因となったこと

#### 下落要因

- 米景気の先行き懸念が高まり、株式市場が下落する局面があったこと

投資環境について(2023年12月1日から2024年12月2日まで)

**国内株式市場は上昇しました。**

期初は、国内企業の業績の上振れや米利下げ観測が支えとなったものの、米ドル高・円高基調などが上値を抑制しました。2024年に入ると、米国株高、米ドル高・円安の進行に加え、日本企業の持続的な業績改善も好感され、日本株も上昇基調に回帰しました。日銀の金融緩和策においてマイナス金利解除などの変更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となり、米ドル高・円安が一段と進行し上昇幅を拡大しました。

夏場に、米ドル高・円安の一段の進行や米国株高を背景に上昇しました。その後は米雇用統計の結果を受け、米景気の先行き懸念が高まり大きく下落しましたが、日銀が追加利上げに慎重な姿勢を示したことで大きく反発しました。

期末にかけては、米国の新大統領に選出されたトランプ氏の政策に対する期待や懸念が入り混じり、レンジの動きとなりました。

ポートフォリオについて(2023年12月1日から2024年12月2日まで)

## 当ファンド

期を通じて「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」を高位に組み入れました。

## 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

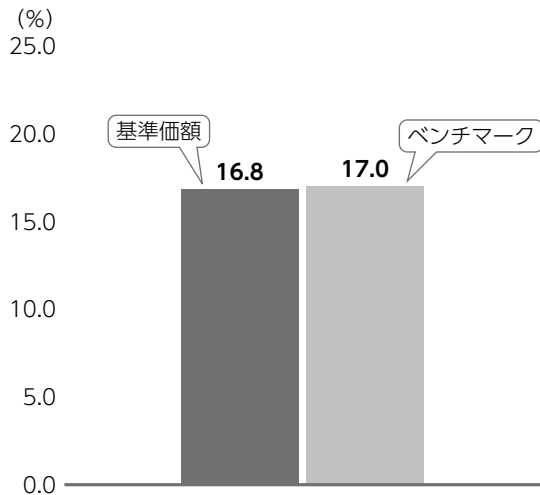
TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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(2023年12月1日から2024年12月2日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは、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+16.8%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+17.0%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12月1日から2024年12月2日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

| 項目                 | 第13期         |
|--------------------|--------------|
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | 0<br>(0.00%) |
| 当期の収益              | -            |
| 当期の収益以外            | -            |
| 翌期繰越分配対象額          | 37,323       |

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

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

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

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

## 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)」を高位に組み入れて運用を行います。

### 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高位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12月1日から2024年12月2日まで)

| 項目                 | 金額         | 比率            | 項目の概要   |
|--------------------|------------|---------------|---|
| <b>(a) 信託報酬</b>    | <b>81円</b> | <b>0.177%</b> | <b>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)</b><br>期中の平均基準価額は45,761円です。          |
| (投信会社)             | (35)       | (0.077)       | 投信会社:ファンド運用の指図等の対価  |
| (販売会社)             | (35)       | (0.077)       | 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)             | (10)       | (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>(b) 売買委託手数料</b> | <b>1</b>   | <b>0.002</b>  | <b>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</b><br>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)         | (1)        | (0.002)       |   |
| (投資信託証券)           | (-)        | (-)           |   |
| <b>(c) 有価証券取引税</b> | <b>-</b>   | <b>-</b>      | <b>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</b><br>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)           | (-)        | (-)           |   |
| <b>(d) その他費用</b>   | <b>2</b>   | <b>0.003</b>  | <b>その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数</b>  |
| (保管費用)             | (-)        | (-)           | 保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送回金・資産の移転等に要する費用                      |
| (監査費用)             | (1)        | (0.003)       | 監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用  |
| (その他)              | (0)        | (0.000)       | その他:信託事務の処理等に要するその他費用   |
| <b>合計</b>          | <b>83</b>  | <b>0.182</b>  |   |

※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。

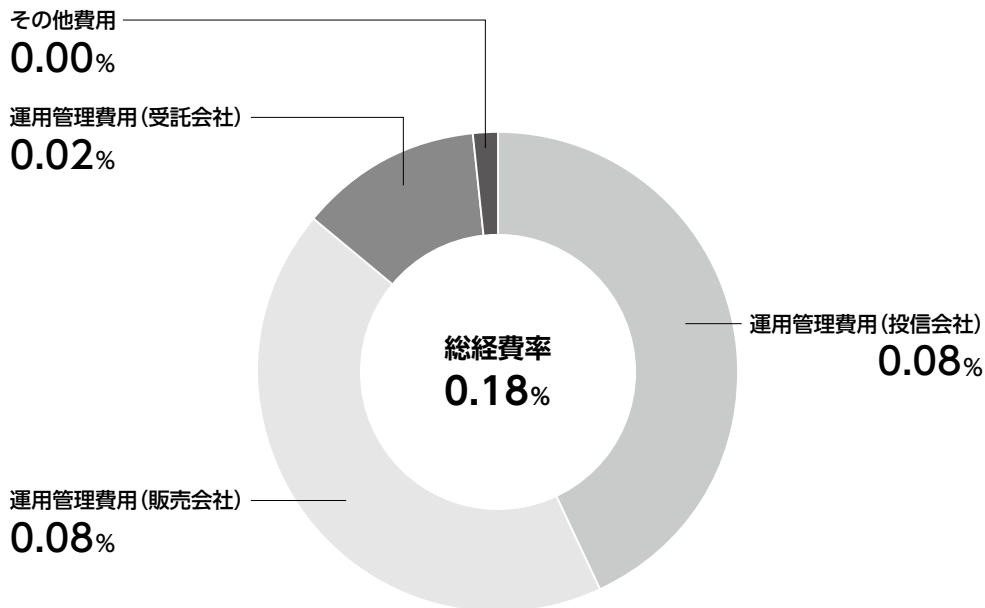
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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0.18%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2023年12月1日から2024年12月2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<br>4,246,759 | 千円<br>20,022,325 | 千口<br>484,788 | 千円<br>2,262,992 |

■ 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12月1日から2024年12月2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         | 47,459,168千円            |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 327,005,810千円           |
| (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 (2023年12月1日から2024年12月2日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

| 区 分 | 買付額等 A          |           |               | 売付額等 C          |           |              |
|-----|-----------------|-----------|---------------|-----------------|-----------|--------------|
|     | うち利害関係人との取引状況 B | B/A       |               | うち利害関係人との取引状況 D | D/C       |              |
| 株 式 | 百万円<br>10,678   | %<br>27.9 | 百万円<br>38,285 | 百万円<br>3,922    | %<br>42.7 | 百万円<br>9,176 |

※平均保有割合 40.8%

※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<br>439 | 百万円<br>119 | 百万円<br>7,022 |

(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

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

| 項 目                         | 当 期     |
|-----------------------------|---------|
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額       | 2,149千円 |
| (b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 | 11千円    |
| (c) (b) / (a)               | 0.5%    |

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

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況  
(2023年12月1日から2024年12月2日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2024年12月2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<br>26,260,180 | 千口<br>30,022,152 千円<br>146,892,386 |

※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72,554,135,505口です。

■ 投資信託財産の構成

(2024年12月2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<br>146,892,386 | %<br>99.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 200,536           | 0.1       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 147,092,923       | 100.0     |

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年12月2日現在)

| 項 目                         | 期 末              |
|-----------------------------|------------------|
| (A) 資 産                     | 147,092,923,395円 |
| コール・ローン等                    | 179,144,006      |
| 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額) | 146,892,386,435  |
| 未 収 入 金                     | 21,392,954       |
| (B) 負 債                     | 327,817,897      |
| 未 払 解 約 金                   | 200,330,730      |
| 未 払 信 託 報 酬                 | 125,356,709      |
| そ の 他 未 払 費 用               | 2,130,458        |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B)        | 146,765,105,498  |
| 元 本                         | 31,013,340,454   |
| 次 期 繰 越 損 益 金               | 115,751,765,044  |
| (D) 受 益 権 総 口 数             | 31,013,340,454口  |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)  | 47,323円          |

※当期における期首元本額27,077,492,077円、期中追加設定元本額7,708,670,536円、期中一部解約元本額3,772,822,159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12月1日 至2024年12月2日)

| 項 目                      | 当 期               |
|--------------------------|-------------------|
| (A) 配 当 等 収 益            | 159,916円          |
| 受 取 利 息                  | 170,321           |
| 支 払 利 息                  | △ 10,405          |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益      | 17,648,188,501    |
| 売 買 益                    | 19,390,833,451    |
| 売 買 損                    | △ 1,742,644,950   |
| (C) 信 託 報 酬 等            | △ 239,360,446     |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | 17,408,987,971    |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金        | 25,133,482,492    |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金      | 73,209,294,581    |
| (配 当 等 相 当 額)            | ( 53,998,333,963) |
| (売 買 損 益 相 当 額)          | ( 19,210,960,618) |
| (G) 合 計(D + E + F)       | 115,751,765,044   |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G)         | 115,751,765,044   |
| 追 加 信 託 差 損 益 金          | 73,209,294,581    |
| (配 当 等 相 当 額)            | ( 54,016,292,976) |
| (売 買 損 益 相 当 額)          | ( 19,193,001,605) |
| 分 配 準 備 積 立 金            | 42,542,470,463    |

※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。

※株式投資の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投資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            | 3,139,545,950円  |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益        | 14,269,442,021  |
| (c) 収益調整金                  | 73,209,294,581  |
| (d) 分配準備積立金                | 25,133,482,492  |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 115,751,765,044 |
| 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額  | 37,323.22       |
| (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22期（2023年12月1日から2024年12月2日まで）

|      |  |
|------|--|
| 信託期間 | 無期限（設定日：2003年2月17日）  |
| 運用方針 | 主として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)<br>TOPIX<br>(東証株価指数、配当込み) |      | 株式組入率<br>株比 | 株式先物率<br>(買建-売建) | 純資産額    |
|------------------|--------|------|------------------------------------|------|-------------|------------------|---------|
|                  | 円      | 騰落率  | 円                                  | 騰落率  |             |                  |         |
| 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 |
| 22期（2024年12月2日）  | 48,928 | 17.0 | 4,664.51                           | 17.0 | 97.9        | 2.1              | 354,995 |

※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)<br>T O P I X<br>(東証株価指数、配当込み) |        | 株 式 組 入 率<br>株 比 | 株 式 先 物 率<br>比<br>(買建-売建) |
|-----------------------|-------------|--------|---|--------|------------------|---------------------------|
|                       | 騰 落 率       | 騰 落 率  | 騰 落 率                                       | 騰 落 率  |                  |                           |
| (期 首)<br>2023年11月30日  | 円<br>41,803 | %<br>— | 3,986.65                                    | %<br>— | %<br>98.3        | %<br>1.6                  |
| 12月末                  | 41,714      | △ 0.2  | 3,977.63                                    | △ 0.2  | 98.8             | 1.1                       |
| 2024年 1 月末            | 44,977      | 7.6    | 4,288.36                                    | 7.6    | 98.8             | 1.3                       |
| 2 月末                  | 47,194      | 12.9   | 4,499.61                                    | 12.9   | 98.9             | 1.0                       |
| 3 月末                  | 49,290      | 17.9   | 4,699.20                                    | 17.9   | 98.2             | 1.8                       |
| 4 月末                  | 48,847      | 16.9   | 4,656.27                                    | 16.8   | 98.1             | 1.9                       |
| 5 月末                  | 49,405      | 18.2   | 4,710.15                                    | 18.1   | 98.0             | 2.0                       |
| 6 月末                  | 50,122      | 19.9   | 4,778.56                                    | 19.9   | 98.4             | 1.6                       |
| 7 月末                  | 49,851      | 19.3   | 4,752.72                                    | 19.2   | 98.9             | 1.1                       |
| 8 月末                  | 48,407      | 15.8   | 4,615.06                                    | 15.8   | 98.6             | 1.3                       |
| 9 月末                  | 47,669      | 14.0   | 4,544.38                                    | 14.0   | 98.1             | 2.0                       |
| 10 月末                 | 48,568      | 16.2   | 4,629.83                                    | 16.1   | 97.9             | 2.1                       |
| 11 月末                 | 48,316      | 15.6   | 4,606.07                                    | 15.5   | 97.9             | 2.1                       |
| (期 末)<br>2024年12月 2 日 | 48,928      | 17.0   | 4,664.51                                    | 17.0   | 97.9             | 2.1                       |

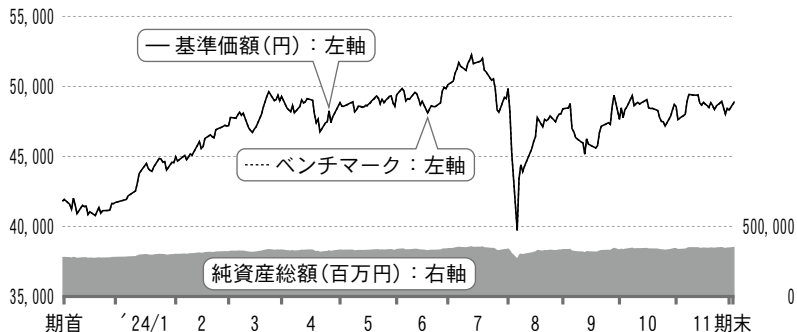
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

# 1 運用経過

## ▶ 基準価額等の推移について（2023年12月1日から2024年12月2日まで）

### 基準価額等の推移



|     |         |
|-----|---------|
| 期首  | 41,803円 |
| 期末  | 48,928円 |
| 騰落率 | +17.0%  |

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、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（2023年12月1日から2024年12月2日まで）

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

|      |   |
|------|---|
| 上昇要因 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・日銀が追加利上げに慎重な姿勢を示し、株式市場が上昇したこと</li> <li>・米国株高、米ドル高・円安が進行し、株価の押上要因となったこと</li> </ul> |
| 下落要因 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・米景気の先行き懸念が高まり、株式市場が下落する局面があったこと</li> </ul>  |

### ▶ 投資環境について（2023年12月1日から2024年12月2日まで）

国内株式市場は上昇しました。

期初は、国内企業の業績の上振れや米利下げ観測が支えとなったものの、米ドル安・円高基調などが上値を抑制しました。2024年に入ると、米国株高、米ドル高・円安の進行に加え、日本企業の持続的な業績改善も好感され、日本株も上昇基調に回帰しました。日銀の金融緩和策においてマイナス金利解除などの変更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となり、米ドル高・円安が一段と進行し上昇幅を拡大しました。

夏場に、米ドル高・円安の一段の進行や米国株高を背景に上昇しました。その後は米雇用統計の結果を受け、米景気の先行き懸念が高まり大きく下落しましたが、日銀が追加利上げに慎重な姿勢を示したことで大きく反発しました。

期末にかけては、米国の新大統領に選出されたトランプ氏の政策に対する期待や懸念が入り混じり、レンジの動きとなりました。

### ▶ ポートフォリオについて（2023年12月1日から2024年12月2日まで）

#### 株式組入比率

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

#### ポートフォリオの特性

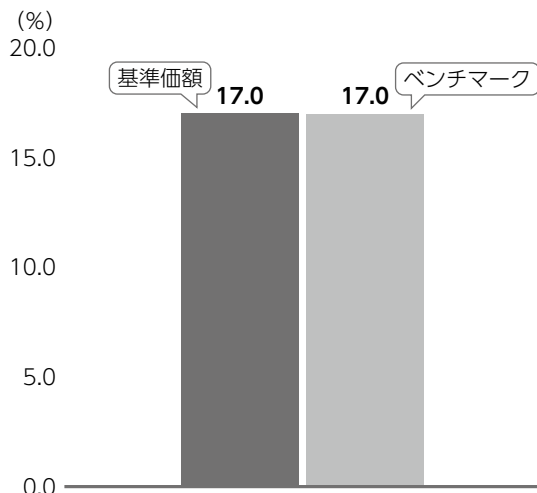
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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

推定トラッキングエラー（ポートフォリオとベンチマークのリターン乖離）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12月1日から2024年12月2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+17.0%となり、ベンチマークの騰落率+17.0%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高位に保つことを基本とします。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

### ■ 1万口当たりの費用明細（2023年12月1日から2024年12月2日まで）

| 項 目  | 金 額                     | 比 率                                     | 項 目 の 概 要  |
|--|-------------------------|---|--|
| (a) 売 買 委 託 手 数 料<br>（株 式）<br>（新 株 予 約 権 証 券）<br>（先 物 ・ オ プ シ ョ ン） | 1円<br>(0)<br>(0)<br>(1) | 0.002%<br>(0.000)<br>(0.000)<br>(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<br>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<br>（そ の 他）   | 0<br>(0)                | 0.000<br>(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<br>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47,269円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 当期中の売買及び取引の状況（2023年12月1日から2024年12月2日まで）

#### (1) 株 式

|     |     | 買 付                      |                   | 売 付       |           |
|-----|-----|--------------------------|-------------------|-----------|-----------|
|     |     | 株 数                      | 金 額               | 株 数       | 金 額       |
| 国 内 | 上 場 | 千株                       | 千円                | 千株        | 千円        |
|     |     | 16,179.4<br>(32,444.482) | 38,285,966<br>( ) | 4,576.626 | 9,173,202 |

※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) 新株予約権証券

|     |  | 買 付          |          | 売 付          |              |
|-----|--|--------------|----------|--------------|--------------|
|     |  | 証 券 数        | 金 額      | 証 券 数        | 金 額          |
| 国 内 |  | 証券           | 千円       | 証券           | 千円           |
|     |  | —<br>(6,800) | —<br>( ) | 6,800<br>( ) | 3,440<br>( ) |

※金額は受渡し代金。

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

#### (3) 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<br>63,640 | 百万円<br>61,743 | 百万円<br>—  | 百万円<br>— |

※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

（2023年12月1日から2024年12月2日まで）

| 項 目                           | 当 期           |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額         | 47,459,168千円  |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 327,005,810千円 |
| (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（2023年12月1日から2024年12月2日まで）

(1) 利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等<br>A      |               |           | 売付額等<br>C      |              |           |
|-----|----------------|---------------|-----------|----------------|--------------|-----------|
|     | うち利害関係人との取引状況B | B/A           |           | うち利害関係人との取引状況D | D/C          |           |
| 株 式 | 百万円<br>38,285  | 百万円<br>10,678 | %<br>27.9 | 百万円<br>9,176   | 百万円<br>3,922 | %<br>42.7 |

(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<br>439 | 百万円<br>119 | 百万円<br>7,022 |

(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       | 5,269千円 |
| (b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 | 26千円    |
| (c) (b)／(a)                 | 0.5%    |

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMBC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12月1日から2024年12月2日まで）

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

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（2024年12月2日現在）

(1) 国内株式

| 銘柄                   | 期首(前期末) |       | 期末      |     |
|----------------------|---------|-------|---------|-----|
|                      | 株数      | 株数    | 評価額     | 評価額 |
|                      | 千株      |       | 千円      |     |
| <b>水産・農林業 (0.1%)</b> |         |       |         |     |
| 極洋                   | 4.1     | 4.6   | 18,262  |     |
| ニッスイ                 | 115.6   | 125.4 | 117,738 |     |
| マルハニチロ               | 17.1    | 18.3  | 55,119  |     |
| 雪国まいたけ               | 11.4    | 14.4  | 14,976  |     |
| カネコ種苗                | 4.7     | 4.8   | 6,595   |     |
| サカタのタネ               | 13.2    | 13.8  | 47,058  |     |
| ホクト                  | 10.1    | 10.1  | 17,594  |     |
| <b>鉱業 (0.3%)</b>     |         |       |         |     |
| 住石ホールディングス           | 14.4    | 16.6  | 13,977  |     |
| 日鉄鉱業                 | 4.5     | 5     | 20,900  |     |
| I N P E X            | 427.2   | 375.9 | 748,604 |     |
| 石油資源開発               | 13.3    | 69    | 75,279  |     |
| K & O エナジーグループ       | 5.5     | 5.9   | 19,824  |     |
| <b>建設業 (2.2%)</b>    |         |       |         |     |
| ショーボンドホールディングス       | 15.7    | 16.4  | 85,034  |     |
| ミライト・ワン              | 38.1    | 40.3  | 86,604  |     |
| タマホーム                | 7.3     | 7.9   | 28,479  |     |
| 日本アクア                | 5       | 3.3   | 2,583   |     |
| 安藤・間                 | 66.3    | 70.4  | 81,875  |     |
| 東急建設                 | 32.3    | 37.4  | 25,806  |     |
| コムシスホールディングス         | 37.5    | 44    | 145,024 |     |
| ビーアールホールディングス        | 21.6    | 18.5  | 6,216   |     |
| 高松コンストラクショングループ      | 7.2     | 8.8   | 23,108  |     |
| 東建コーポレーション           | 3.2     | 3.2   | 35,488  |     |
| ヤマウラ                 | 6.9     | 6.3   | 7,352   |     |
| オリエンタル白石             | 44      | 44    | 16,984  |     |
| 大成建設                 | 75.7    | 79.7  | 527,853 |     |
| 大林組                  | 288.9   | 289.8 | 620,461 |     |
| 清水建設                 | 233.6   | 249.6 | 297,148 |     |
| 飛鳥建設                 | 9.6     | —     | —       |     |
| 長谷工コーポレーション          | 83      | 80.8  | 163,418 |     |
| 松井建設                 | 8.2     | 9.7   | 8,186   |     |
| 銭高組                  | 1.5     | 0.2   | 758     |     |
| 鹿島建設                 | 179.1   | 194.5 | 537,306 |     |
| 不動テトラ                | 5.6     | 5.9   | 12,047  |     |
| 鉄建建設                 | 6.7     | 5.7   | 12,887  |     |
| 西松建設                 | 13.9    | 13.8  | 70,173  |     |
| 三井住友建設               | 65.6    | 74.7  | 30,253  |     |
| 大豊建設                 | 3.6     | 1.3   | 4,309   |     |

| 銘柄             | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|----------------|---------|-------|-----------|-----|
|                | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| 奥村組            | 12.9    | 15.1  | 58,210    |     |
| 東鉄工業           | 10.9    | 10.9  | 34,880    |     |
| 浅沼組            | 6.4     | 31    | 19,902    |     |
| 戸田建設           | 99.9    | 113   | 105,858   |     |
| 熊谷組            | 13.4    | 14.1  | 50,478    |     |
| 北野建設           | 1.9     | 1.2   | 4,896     |     |
| 矢作建設工業         | 11.5    | 11.5  | 16,985    |     |
| ピーエス・コンストラクション | 10.9    | 4.5   | 4,689     |     |
| 日本ハウスホールディングス  | 19.5    | 19.5  | 6,532     |     |
| 新日本建設          | 11.5    | 11.5  | 17,365    |     |
| 東亜道路工業         | 3.4     | 17    | 21,743    |     |
| 日本道路           | 8.5     | 8.2   | 14,292    |     |
| 東亜建設工業         | 7.1     | 26.8  | 31,570    |     |
| 日本国土開発         | 24.3    | 25.9  | 13,131    |     |
| 若築建設           | 3.9     | 2.4   | 8,736     |     |
| 東洋建設           | 26.3    | 23.3  | 29,800    |     |
| 五洋建設           | 114.6   | 120.9 | 74,534    |     |
| 世紀東急工業         | 10.8    | 10.8  | 16,264    |     |
| 福田組            | 3.1     | 3.2   | 16,928    |     |
| 住友林業           | 69.7    | 75.2  | 424,128   |     |
| 日本基礎技術         | 7.5     | —     | —         |     |
| バコーポレーション      | 11.5    | 5.1   | 5,232     |     |
| 大和ハウス工業        | 223.5   | 264.4 | 1,254,049 |     |
| ライト工業          | 14.4    | 16.1  | 35,226    |     |
| 積水ハウス          | 244.9   | 264   | 946,176   |     |
| 日特建設           | 8.2     | 6.8   | 6,725     |     |
| 北陸電気工事         | —       | 6.1   | 6,728     |     |
| ユアテック          | 17.8    | 19.1  | 27,179    |     |
| 日本リーテック        | 7.7     | 7.7   | 8,785     |     |
| 四電工            | 3.5     | 10.5  | 15,487    |     |
| 中電工            | 11.5    | 13    | 43,810    |     |
| 関電工            | 49      | 51.9  | 115,373   |     |
| きんでん           | 56.5    | 60.5  | 187,429   |     |
| 東京エネシス         | 8.7     | 8.7   | 9,100     |     |
| トーエネック         | 2.9     | 14.5  | 14,007    |     |
| 住友電設           | 7.4     | 8.1   | 38,961    |     |
| 日本電設工業         | 13.2    | 15    | 28,545    |     |
| エクシオグループ       | 36.8    | 92.7  | 161,390   |     |
| 新日本空調          | 5.3     | 5.5   | 21,697    |     |
| 九電工            | 19.7    | 18.9  | 97,939    |     |
| 三機工業           | 16.9    | 17.6  | 49,913    |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 期末      |     |
|------------------|---------|-------|---------|-----|
|                  | 株数      | 株数    | 評価額     | 評価額 |
| 日揮ホールディングス       | 80      | 86.1  | 111,973 |     |
| 中外炉工業            | 3.3     | 3     | 9,855   |     |
| ヤマト              | 7       | 4     | 4,792   |     |
| 太平電業             | 5       | 5.5   | 27,362  |     |
| 高砂熱学工業           | 19.3    | 22.8  | 136,800 |     |
| 三晃金属工業           | 1.3     | 0.1   | 433     |     |
| 朝日工業社            | 4       | 8     | 15,512  |     |
| 明星工業             | 16      | 16.4  | 21,894  |     |
| 大気社              | 9.2     | 10.8  | 50,976  |     |
| ダイダン             | 10.6    | 11.2  | 40,320  |     |
| 日比谷総合設備          | 6.9     | 6.9   | 27,427  |     |
| 飛鳥ホールディングス       | —       | 9.4   | 14,720  |     |
| テスホールディングス       | 18.2    | 19.3  | 5,326   |     |
| インフロニア・ホールディングス  | 86.9    | 94.6  | 114,229 |     |
| 東洋エンジニアリング       | 11.3    | 12.3  | 8,769   |     |
| レイズネクスト          | 11.4    | 12.8  | 19,507  |     |
| <b>食料品（3.2%）</b> |         |       |         |     |
| ニッポン             | 21.4    | 26.2  | 55,806  |     |
| 日清製粉グループ本社       | 75      | 91.8  | 169,233 |     |
| 日東富士製粉           | 1.7     | 1.7   | 11,169  |     |
| 昭和産業             | 6.7     | 7.2   | 20,066  |     |
| 鳥越製粉             | 10.7    | 10.7  | 7,350   |     |
| 中部飼料             | 11.3    | 12.4  | 16,268  |     |
| フィード・ワン          | 12.9    | 12.9  | 10,307  |     |
| 日本甜菜製糖           | 5.2     | 5.2   | 12,407  |     |
| D M三井製糖ホールディングス  | 7.9     | 8.4   | 26,796  |     |
| ウェルネオシュガー        | 4.7     | 4.7   | 10,142  |     |
| 森永製菓             | 15      | 36.7  | 102,136 |     |
| 中村屋              | 2.8     | 3.1   | 9,904   |     |
| 江崎グリコ            | 23.2    | 25.4  | 112,445 |     |
| 井村屋グループ          | 4.8     | 4.9   | 11,858  |     |
| 不二家              | 5.7     | 5.8   | 15,491  |     |
| 山崎製パン            | 54.6    | 59.2  | 167,654 |     |
| モロゾフ             | 2.8     | 2.7   | 11,961  |     |
| 亀田製菓             | 5.1     | 5.6   | 23,380  |     |
| 寿スピリッツ           | 43      | 52.2  | 112,125 |     |
| カルビー             | 37.3    | 40.8  | 129,336 |     |
| 森永乳業             | 29.6    | 33.7  | 98,808  |     |
| 六甲バター            | 6.3     | 6.5   | 9,054   |     |
| ヤクルト本社           | 116.2   | 126.3 | 388,751 |     |
| 明治ホールディングス       | 99.5    | 118.1 | 378,628 |     |
| 雪印メグミルク          | 19.5    | 23.4  | 64,022  |     |
| プリマハム            | 10.6    | 10.9  | 23,685  |     |
| 日本ハム             | 31.7    | 37.9  | 195,033 |     |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|------------------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                              | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| 丸大食品                         | 8.4     | 8.4   | 14,338    |     |
| S Foods                      | 8.9     | 9.4   | 24,966    |     |
| 柿安本店                         | 3.3     | 3.2   | 8,828     |     |
| 伊藤ハム米久ホールディングス               | 12.1    | 12.9  | 48,891    |     |
| サッポロホールディングス                 | 26.7    | 29.1  | 257,680   |     |
| アサヒグループホールディングス              | 187.5   | 655.6 | 1,058,794 |     |
| キリンホールディングス                  | 338.3   | 366   | 773,541   |     |
| シマダヤ                         | —       | 4.5   | 6,466     |     |
| 宝ホールディングス                    | 54.8    | 58.6  | 75,564    |     |
| オエノンホールディングス                 | 26.2    | 29.2  | 12,088    |     |
| 養命酒製造                        | —       | 3     | 7,548     |     |
| コカ・コーラ ボトラーズ<br>ジャパンホールディングス | 63.6    | 62.5  | 151,812   |     |
| ライフドリンク カンパニー                | 1.7     | 19    | 46,075    |     |
| サントリー食品インターナショナル             | 57.1    | 62.4  | 320,236   |     |
| グライドグループホールディングス             | 4.5     | 9.6   | 33,264    |     |
| 伊藤園                          | 27.5    | 29.8  | 98,340    |     |
| キーコーヒー                       | 8.4     | 9.8   | 20,217    |     |
| 日清オイリオグループ                   | 11.3    | 12    | 60,360    |     |
| 不二製油グループ本社                   | 18.9    | 18.9  | 66,471    |     |
| かどや製油                        | 1.8     | 1.8   | 6,453     |     |
| J-オイルミルズ                     | 8.3     | 8.8   | 19,078    |     |
| キッコーマン                       | 53.7    | 292.2 | 479,208   |     |
| 味の素                          | 195.8   | 203   | 1,291,080 |     |
| ブルドックソース                     | 4.7     | 4.7   | 8,652     |     |
| キュービー                        | 43.6    | 47.6  | 165,648   |     |
| ハウス食品グループ本社                  | 24.8    | 29.6  | 84,404    |     |
| カゴメ                          | 36.4    | 37.3  | 111,340   |     |
| アリアケジャパン                     | 7.2     | 8.8   | 48,048    |     |
| エバラ食品工業                      | 2.8     | 2.8   | 7,994     |     |
| やまみ                          | —       | 0.9   | 3,609     |     |
| ニチレイ                         | 37.3    | 36.8  | 157,430   |     |
| 東洋水産                         | 41.1    | 40.7  | 437,321   |     |
| イートアンドホールディングス               | 4.1     | 4.1   | 8,745     |     |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス            | 5.8     | 5     | 6,665     |     |
| 日清食品ホールディングス                 | 28.6    | 113.9 | 457,194   |     |
| 永谷園ホールディングス                  | 4.2     | —     | —         |     |
| フジッコ                         | 7.6     | 7.6   | 13,056    |     |
| ロック・フィールド                    | 9.1     | 9.6   | 14,313    |     |
| 日本たばこ産業                      | 493.4   | 535.2 | 2,259,079 |     |
| ケンコーマヨネーズ                    | 6.3     | 6.3   | 13,412    |     |
| わらべや日洋ホールディングス               | 6.2     | 6.2   | 12,319    |     |
| なとり                          | 5.4     | 4.9   | 10,348    |     |
| ファーマフーズ                      | 11.8    | 12.2  | 12,004    |     |



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      | 価額 |
| ユーグレナ               | 51.5    | 56.5  | 22,600  |    |
| 紀文食品                | 7.1     | 7.1   | 7,810   |    |
| ビックスホールディングス        | 5.2     | 5.2   | 5,366   |    |
| ミヨシ油脂               | 5.2     | 0.2   | 320     |    |
| 理研ビタミン              | 7.2     | 7.2   | 17,906  |    |
| <b>繊維製品 (0.4%)</b>  |         |       |         |    |
| 片倉工業                | 9       | 9     | 17,928  |    |
| グンゼ                 | 5.9     | 8     | 41,440  |    |
| 東洋紡                 | 36.1    | 47    | 43,569  |    |
| ユニチカ                | 30.5    | 30.5  | 5,917   |    |
| 富士紡ホールディングス         | 3.5     | 4     | 21,800  |    |
| 倉敷紡績                | 6.6     | 8     | 45,360  |    |
| シキボウ                | 6.1     | 5.7   | 5,660   |    |
| 日本毛織                | 21.8    | 27.8  | 34,972  |    |
| ダイドーリミテッド           | —       | 2.7   | 2,384   |    |
| 帝国繊維                | 9.3     | 12.3  | 30,208  |    |
| 帝人                  | 79.7    | 85.1  | 112,417 |    |
| 東レ                  | 554.1   | 643.9 | 619,882 |    |
| ダイニック               | 6.3     | 3.3   | 2,471   |    |
| セーレン                | 16      | 17.3  | 47,990  |    |
| 小松マテーレ              | 13.3    | 13.9  | 11,036  |    |
| ワコールホールディングス        | 15.3    | 17.7  | 90,110  |    |
| ホギメディカル             | 11.2    | 13.8  | 66,033  |    |
| T S Iホールディングス       | 28.5    | 28.8  | 25,632  |    |
| ワールド                | 10.8    | 17    | 38,063  |    |
| 三陽商会                | 2.8     | 5.7   | 15,549  |    |
| オンワードホールディングス       | 54.6    | 54.6  | 28,883  |    |
| ルックホールディングス         | 2.6     | 3.7   | 9,472   |    |
| ゴールドウイン             | 14.7    | 15.9  | 140,476 |    |
| デサント                | 14.3    | —     | —       |    |
| <b>パルプ・紙 (0.1%)</b> |         |       |         |    |
| 特種東海製紙              | 4       | 4.9   | 17,297  |    |
| 王子ホールディングス          | 344.4   | 338.9 | 187,445 |    |
| 日本製紙                | 43.6    | 25    | 21,525  |    |
| 北越コーポレーション          | 51      | 53.9  | 81,820  |    |
| 大王製紙                | 37      | 49.7  | 41,201  |    |
| レンゴー                | 75.9    | 81    | 71,725  |    |
| トーモク                | 5.4     | 5.4   | 11,874  |    |
| ザ・バック               | 6.2     | 6.8   | 24,446  |    |
| <b>化学 (5.3%)</b>    |         |       |         |    |
| 北の達人コーポレーション        | 37.7    | 41.5  | 6,017   |    |
| クラレ                 | 122.3   | 129   | 267,739 |    |
| 旭化成                 | 531.9   | 605.2 | 646,051 |    |
| レゾナック・ホールディングス      | 79.7    | 80.5  | 326,427 |    |

| 銘柄           | 期首(前期末) |       | 期末        |    |
|--------------|---------|-------|-----------|----|
|              | 株数      | 株数    | 評価        | 価額 |
| 住友化学         | 611.8   | 723.6 | 267,732   |    |
| 住友精化         | 3.5     | 5.4   | 25,326    |    |
| 日産化学         | 38.9    | 46.2  | 240,009   |    |
| ラサ工業         | 3.5     | 3.4   | 9,125     |    |
| クレハ          | 6.8     | 19.6  | 55,134    |    |
| 多木化学         | 3.3     | 3.5   | 12,092    |    |
| テイカ          | 5.9     | 7.6   | 12,372    |    |
| 石原産業         | 14.8    | 14.8  | 21,578    |    |
| 日本曹達         | 8.8     | 20.2  | 54,580    |    |
| 東ソー          | 110     | 119   | 246,449   |    |
| トクヤマ         | 26.6    | 29    | 77,734    |    |
| セントラル硝子      | 13.3    | 10.4  | 34,320    |    |
| 東亜合成         | 41.1    | 41.6  | 63,648    |    |
| 大阪ソーダ        | 5.1     | 31    | 45,539    |    |
| 関東電化工業       | 16.4    | 17.8  | 18,814    |    |
| デンカ          | 30.1    | 34.8  | 74,002    |    |
| 信越化学工業       | 743.1   | 803.4 | 4,455,656 |    |
| 日本カーバイド工業    | —       | 3.8   | 6,277     |    |
| 堺化学工業        | 6.3     | 6.6   | 17,430    |    |
| 第一稀元素化学工業    | 8       | 8.3   | 5,893     |    |
| エア・ウォーター     | 78      | 83    | 154,463   |    |
| 日本酸素ホールディングス | 80      | 87.3  | 380,715   |    |
| 日本化学工業       | 3       | 3     | 7,209     |    |
| 日本パーカライジング   | 39.8    | 39    | 49,881    |    |
| 高圧ガス工業       | 12.8    | 12.6  | 10,029    |    |
| 四国化成ホールディングス | 11      | 11    | 22,539    |    |
| 戸田工業         | 2.1     | —     | —         |    |
| ステラ ケミファ     | 5       | 4.8   | 19,056    |    |
| 保土谷化学工業      | 2.4     | 2.8   | 10,780    |    |
| 日本触媒         | 12.6    | 56.9  | 103,785   |    |
| 大日精化工業       | 5.8     | 5.8   | 16,721    |    |
| カネカ          | 21      | 23.4  | 81,806    |    |
| 三菱瓦斯化学       | 63      | 71.7  | 203,054   |    |
| 三井化学         | 69      | 80.3  | 277,035   |    |
| J S R        | 77.2    | —     | —         |    |
| 東京応化工業       | 13.3    | 42.4  | 150,392   |    |
| 大阪有機化学工業     | 6.8     | 7.7   | 20,497    |    |
| 三菱ケミカルグループ   | 582.5   | 653.4 | 518,276   |    |
| K Hネオケム      | 13.3    | 14.8  | 30,399    |    |
| ダイセル         | 117.4   | 103.8 | 142,413   |    |
| 住友ベークライト     | 12.2    | 27.9  | 102,476   |    |
| 積水化学工業       | 167     | 178.5 | 429,917   |    |
| 日本ゼオン        | 56      | 69    | 96,979    |    |
| アイカ工業        | 20.7    | 22.5  | 73,327    |    |

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        | 価額 |
| UBE            | 42.3    | 43.4  | 104,811   |    |
| 積水樹脂           | 11.3    | 13.3  | 28,036    |    |
| タキロンシーアイ       | 18.9    | —     | —         |    |
| 旭有機材           | 5.5     | 5.9   | 25,281    |    |
| ニチバン           | 5.7     | 5.5   | 10,587    |    |
| リケンテクノス        | 18.2    | 18.2  | 19,528    |    |
| 大倉工業           | 4       | 4     | 12,360    |    |
| 積水化成成品工業       | —       | 9.7   | 3,521     |    |
| 群栄化学工業         | 2.1     | 2.1   | 5,640     |    |
| ミライアル          | 2.7     | 0.5   | 711       |    |
| ダイキョーニシカワ      | 18.6    | 18.6  | 11,346    |    |
| 森六ホールディングス     | 4.4     | 4.4   | 8,685     |    |
| 恵和             | 6.1     | 6.3   | 6,230     |    |
| 日本化薬           | 64      | 69    | 88,216    |    |
| カーリット          | 8.7     | 8.9   | 11,739    |    |
| 日本精化           | 4.8     | 6.1   | 15,152    |    |
| 扶桑化学工業         | 7.5     | 9.4   | 32,054    |    |
| トリケミカル研究所      | 11      | 10.8  | 30,250    |    |
| ADEKA          | 30      | 30.5  | 82,960    |    |
| 日油             | 25.5    | 105.2 | 237,752   |    |
| 新日本理化          | 15.6    | —     | —         |    |
| ハリマ化成グループ      | 5.8     | 5.8   | 4,959     |    |
| 花王             | 186.9   | 218.5 | 1,426,805 |    |
| 第一工業製薬         | 3.3     | 3.7   | 14,060    |    |
| 石原ケミカル         | 4.2     | 4.2   | 10,869    |    |
| 三洋化成工業         | 4.8     | 5.8   | 22,910    |    |
| 大日本塗料          | 10.8    | 9.7   | 11,028    |    |
| 日本ペイントホールディングス | 438.6   | 398.2 | 415,123   |    |
| 関西ペイント         | 81      | 75.9  | 162,615   |    |
| 中国塗料           | 13.8    | 19.4  | 45,396    |    |
| 日本特殊塗料         | 5.2     | 2     | 2,498     |    |
| 藤倉化成           | 12.9    | 13.7  | 7,178     |    |
| 太陽ホールディングス     | 12.3    | 15.5  | 65,952    |    |
| DIC            | 33      | 33.2  | 108,730   |    |
| サカタインクス        | 18.3    | 21.5  | 32,852    |    |
| artience       | 17.2    | 18.5  | 58,645    |    |
| 富士フイルムホールディングス | 156.4   | 540.4 | 1,838,981 |    |
| 資生堂            | 172.7   | 187.7 | 500,502   |    |
| ライオン           | 108.6   | 115.2 | 206,668   |    |
| 高砂香料工業         | 5.6     | 6.8   | 37,128    |    |
| マンダム           | 17.9    | 21.3  | 27,391    |    |
| ミルボン           | 11.7    | 14.5  | 50,170    |    |
| ファンケル          | 36.3    | —     | —         |    |
| コーセー           | 16.8    | 18.5  | 122,766   |    |

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 期末        |    |
|------------------|---------|-------|-----------|----|
|                  | 株数      | 株数    | 評価        | 価額 |
| コタ               | 8       | 8.6   | 13,846    |    |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 42.6    | 47.2  | 65,230    |    |
| ノエビアホールディングス     | 7.3     | 8.3   | 40,877    |    |
| 新日本製薬            | 5       | 5     | 9,645     |    |
| l - n e          | 1.1     | 3.2   | 6,560     |    |
| アクシージア           | 4.8     | 6.3   | 3,509     |    |
| エステー             | 7.1     | 7     | 10,437    |    |
| アグロ カネショウ        | 3.9     | —     | —         |    |
| コニシ              | 13.7    | 27.1  | 36,774    |    |
| 長谷川香料            | 15.8    | 18.4  | 60,720    |    |
| 小林製薬             | 24.1    | 23.8  | 140,539   |    |
| 荒川化学工業           | 7.7     | 7.7   | 8,577     |    |
| メック              | 6.7     | 7.6   | 25,574    |    |
| 日本高純度化学          | 2.4     | 2.3   | 7,475     |    |
| タカラバイオ           | 22.2    | 28.4  | 29,365    |    |
| JCU              | 9.2     | 9.8   | 39,151    |    |
| 新田ゼラチン           | 6       | 6     | 4,494     |    |
| OATアグリオ          | 2.7     | 3.3   | 6,656     |    |
| デクセリアルズ          | 23      | 75.6  | 184,388   |    |
| アース製薬            | 7.4     | 8.5   | 46,240    |    |
| 北興化学工業           | 9.6     | 9.6   | 12,585    |    |
| 大成ラミック           | 3.5     | 3.5   | 8,767     |    |
| クミアイ化学工業         | 33.1    | 34.6  | 27,299    |    |
| 日本農薬             | 15.9    | 16.9  | 11,407    |    |
| アキレス             | 5.7     | 5.7   | 8,230     |    |
| 有沢製作所            | 14.4    | 15.9  | 22,911    |    |
| 日東電工             | 55.9    | 283.1 | 681,563   |    |
| レック              | 12.8    | 12.6  | 15,964    |    |
| 三光合成             | 11.7    | 11.7  | 6,797     |    |
| きもと              | 21.6    | —     | —         |    |
| ZACROS           | 6.3     | 7     | 28,875    |    |
| 前澤化成工業           | 5.9     | 6     | 10,704    |    |
| 未来工業             | 3.2     | 3.4   | 13,430    |    |
| JSP              | 6       | 6     | 12,624    |    |
| エフビコ             | 15.9    | 20.3  | 55,682    |    |
| 天馬               | 6.4     | 6.8   | 20,468    |    |
| 信越ポリマー           | 14.8    | 19.2  | 32,064    |    |
| 東リ               | 20      | —     | —         |    |
| ニフコ              | 29.8    | 33.3  | 118,814   |    |
| バルカー             | 6.8     | 7.5   | 24,787    |    |
| ユニ・チャーム          | 172.4   | 187.3 | 733,466   |    |
| 医薬品（4.6%）        |         |       |           |    |
| 協和キリン            | 103     | 107.5 | 266,438   |    |
| 武田薬品工業           | 731.8   | 796.5 | 3,280,783 |    |

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

| 銘柄                    | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|-----------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                       | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| アステラス製薬               | 736.4   | 786.3   | 1,245,499 |     |
| 住友ファーマ                | 61.9    | —       | —         |     |
| 塩野義製薬                 | 104.5   | 297.1   | 630,891   |     |
| わかもと製薬                | —       | 9       | 2,151     |     |
| 日本新薬                  | 23      | 23.5    | 102,107   |     |
| 中外製薬                  | 258.8   | 280.3   | 1,851,381 |     |
| 科研製薬                  | 16      | 15.1    | 65,186    |     |
| エーザイ                  | 100.6   | 119.2   | 553,207   |     |
| ロート製薬                 | 82      | 95.1    | 276,550   |     |
| 小野薬品工業                | 177     | 183.3   | 317,658   |     |
| 久光製薬                  | 19.5    | 20.2    | 85,526    |     |
| 持田製薬                  | 11      | 11.3    | 38,250    |     |
| 参天製薬                  | 155     | 170.7   | 291,043   |     |
| 扶桑薬品工業                | 4       | 4.5     | 11,677    |     |
| ツムラ                   | 28      | 30.8    | 150,612   |     |
| キッセイ薬品工業              | 15.5    | 15.5    | 57,350    |     |
| 生化学工業                 | 15.9    | 19      | 15,219    |     |
| 栄研化学                  | 17      | 17.3    | 37,835    |     |
| 鳥居薬品                  | 5       | 5.3     | 25,069    |     |
| JCRファーマ               | 28.5    | 31.8    | 23,500    |     |
| 東和薬品                  | 12.7    | 14.5    | 40,556    |     |
| 富士製薬工業                | 7.9     | 7.9     | 12,916    |     |
| ゼリア新薬工業               | 11.3    | 14      | 32,522    |     |
| ネクスセラファーマ             | 26.9    | 42.7    | 48,165    |     |
| 第一三共                  | 720.4   | 844.8   | 4,115,020 |     |
| 杏林製薬                  | 17.4    | 21.9    | 32,236    |     |
| 大幸薬品                  | 18.1    | 24.4    | 8,759     |     |
| ダイト                   | 8       | 8       | 16,720    |     |
| 大塚ホールディングス            | 172.5   | 223.8   | 1,980,406 |     |
| ペプチドリーム               | 45      | 43.8    | 130,721   |     |
| セルソース                 | —       | 8.6     | 9,331     |     |
| あすか製薬ホールディングス         | 9.7     | 9.9     | 19,800    |     |
| サワイグループホールディングス       | 20      | 54.3    | 116,962   |     |
| <b>石油・石炭製品 (0.5%)</b> |         |         |           |     |
| 日本コークス工業              | 83.3    | 95.1    | 9,034     |     |
| ニチレキグループ              | 9.6     | 11.8    | 28,438    |     |
| ユシロ化学工業               | 5.8     | 4.5     | 9,405     |     |
| 富士石油                  | 22.1    | 26.2    | 7,650     |     |
| 出光興産                  | 91.6    | 419.5   | 421,387   |     |
| ENEOSホールディングス         | 1,317.1 | 1,516.5 | 1,243,075 |     |
| コスモエネルギーホールディングス      | 25      | 29.3    | 192,120   |     |
| <b>ゴム製品 (0.6%)</b>    |         |         |           |     |
| 横浜ゴム                  | 42.2    | 45.3    | 138,029   |     |
| TOYO TIRE             | 47.4    | 50.9    | 119,793   |     |

| 銘柄                     | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|------------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                        | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| ブリヂストン                 | 241.6   | 262.7 | 1,407,021 |     |
| 住友ゴム工業                 | 81.1    | 88.7  | 145,734   |     |
| 藤倉コンポジット               | —       | 7.8   | 11,481    |     |
| オカモト                   | 4.1     | 5.1   | 28,101    |     |
| フコク                    | 5       | 5     | 8,595     |     |
| ニッタ                    | 8.2     | 9.1   | 32,259    |     |
| 住友理工                   | 13.8    | 17.4  | 26,813    |     |
| 三ツ星ベルト                 | 11.3    | 11.9  | 48,790    |     |
| バンドー化学                 | 12.7    | 12.7  | 22,948    |     |
| <b>ガラス・土石製品 (0.7%)</b> |         |       |           |     |
| 日東紡績                   | 10.5    | 11.3  | 65,992    |     |
| AGC                    | 74      | 87.5  | 412,037   |     |
| 日本山村硝子                 | 2.4     | 2.7   | 4,546     |     |
| 日本電気硝子                 | 33.5    | 35    | 119,665   |     |
| オハラ                    | 5.3     | 5.3   | 6,386     |     |
| 住友大阪セメント               | 11.8    | 16    | 53,440    |     |
| 太平洋セメント                | 52.6    | 54.8  | 209,226   |     |
| 日本ヒューム                 | 11      | 8.4   | 10,945    |     |
| 日本コンクリート工業             | 21.5    | 19.1  | 7,277     |     |
| 三谷セキサン                 | 4       | 4     | 22,680    |     |
| アジアパイルホールディングス         | 18.5    | 13.5  | 11,272    |     |
| 東海カーボン                 | 76.3    | 80.9  | 73,441    |     |
| 日本カーボン                 | 4.9     | 4.7   | 20,774    |     |
| 東洋炭素                   | 6.1     | 6.2   | 27,373    |     |
| ノリタケ                   | 4.8     | 9.6   | 35,904    |     |
| TOTO                   | 54.5    | 65.3  | 262,375   |     |
| 日本碍子                   | 95.9    | 103.2 | 203,458   |     |
| 日本特殊陶業                 | 65.2    | 72.9  | 338,766   |     |
| ダントーホールディングス           | 5       | —     | —         |     |
| MARUWA                 | 3.2     | 3.7   | 160,913   |     |
| 品川リフラクトリーズ             | 13      | 10.7  | 17,826    |     |
| 黒崎播磨                   | 2       | 7.2   | 16,920    |     |
| ヨータイ                   | 6.2     | 5     | 7,750     |     |
| 東京窯業                   | 13.6    | 10.7  | 4,387     |     |
| フジミンコポーレーテッド           | 22      | 24.1  | 57,165    |     |
| ニチアス                   | 22      | 22.3  | 131,458   |     |
| ニチハ                    | 10.5    | 11.1  | 32,023    |     |
| <b>鉄鋼 (0.8%)</b>       |         |       |           |     |
| 日本製鉄                   | 380.8   | 466.5 | 1,427,490 |     |
| 神戸製鋼所                  | 171     | 182.7 | 284,555   |     |
| 中山製鋼所                  | 18      | 19.4  | 14,084    |     |
| 合同製鐵                   | 4       | 4.7   | 17,930    |     |
| JFEホールディングス            | 237     | 277   | 474,085   |     |
| 東京製鐵                   | 24.1    | 25.8  | 38,106    |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                | 期首(前期末) |       | 期末      |     |
|-------------------|---------|-------|---------|-----|
|                   | 株数      | 株数    | 評価額     | 評価額 |
| 共英製鋼              | 9.6     | 10    | 17,330  |     |
| 大和工業              | 15.5    | 17    | 131,410 |     |
| 東京鐵鋼              | 4.3     | 4     | 25,480  |     |
| 大阪製鐵              | 5.3     | 5.3   | 17,914  |     |
| 淀川製鋼所             | 9.3     | 9.8   | 50,960  |     |
| 中部鋼板              | 7.3     | 6.5   | 14,131  |     |
| 丸一鋼管              | 25.7    | 28.6  | 92,521  |     |
| モリ工業              | 2       | 2     | 9,360   |     |
| 大同特殊鋼             | 10.7    | 57.8  | 67,626  |     |
| 日本冶金工業            | 6.2     | 6.4   | 25,216  |     |
| 山陽特殊製鋼            | 8.2     | 9.3   | 16,851  |     |
| 愛知製鋼              | 5.1     | 5.1   | 24,480  |     |
| 日本金属              | 3.6     | 3.6   | 2,343   |     |
| 大平洋金属             | 6.3     | 8.4   | 11,835  |     |
| 新日本電工             | 50.9    | 52.4  | 15,143  |     |
| 栗本鐵工所             | 4.6     | 4.5   | 18,517  |     |
| 三菱製鋼              | 5.8     | 6.4   | 8,889   |     |
| 日本精線              | 1.3     | 7.7   | 9,802   |     |
| エンビプロ・ホールディングス    | —       | 9.2   | 3,808   |     |
| 新家工業              | 2       | —     | —       |     |
| <b>非鉄金属（0.8%）</b> |         |       |         |     |
| 大紀アルミニウム工業所       | 12.2    | 12.2  | 12,944  |     |
| 日本軽金属ホールディングス     | 23.9    | 25.9  | 39,601  |     |
| 三井金属鉱業            | 25.2    | 23.7  | 114,020 |     |
| 三菱マテリアル           | 61.8    | 65.5  | 158,903 |     |
| 住友金属鉱山            | 98.8    | 117.1 | 434,089 |     |
| DOWAホールディングス      | 20.5    | 24.8  | 111,575 |     |
| 古河機械金属            | 12.9    | 12.9  | 20,382  |     |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ    | 14.4    | 16.2  | 32,416  |     |
| 東邦チタニウム           | 16.5    | 19.6  | 21,050  |     |
| UACJ              | 12      | 13    | 70,850  |     |
| CKサンエツ            | 2.4     | 2.3   | 8,567   |     |
| 古河電気工業            | 28.8    | 30.8  | 197,674 |     |
| 住友電気工業            | 319     | 318.4 | 938,961 |     |
| フジクラ              | 99.1    | 98.8  | 559,405 |     |
| SWCC              | 9.7     | 12.2  | 96,380  |     |
| 平河ビューテック          | 5.5     | 6.3   | 9,387   |     |
| リョービ              | 9.3     | 9.7   | 20,855  |     |
| アーレスティ            | 8.5     | 7.1   | 3,642   |     |
| AREホールディングス       | 34.6    | 37.2  | 64,095  |     |
| <b>金属製品（0.5%）</b> |         |       |         |     |
| 稲葉製作所             | 6.2     | 6.2   | 10,912  |     |
| 宮地エンジニアリンググループ    | 4.8     | 10.4  | 19,562  |     |
| トーカロ              | 22.1    | 26.4  | 46,807  |     |

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 期末      |     |
|------------------|---------|-------|---------|-----|
|                  | 株数      | 株数    | 評価額     | 評価額 |
| アルファ             | 4.2     | 1.7   | 1,781   |     |
| SUMCO            | 151.1   | 174.7 | 209,902 |     |
| 川田テクノロジーズ        | 2.3     | 6.9   | 18,643  |     |
| RS Technologies  | 5.9     | 7.1   | 23,252  |     |
| ジェイテックコーポレーション   | 1.2     | 1.6   | 2,176   |     |
| 信和               | 9.9     | 7.9   | 5,917   |     |
| 東洋製罐グループホールディングス | 50.9    | 58.2  | 139,039 |     |
| ホッカンホールディングス     | 5.5     | 5.1   | 8,685   |     |
| 横河ブリッジホールディングス   | 10.5    | 14.3  | 39,439  |     |
| 駒井ハルテック          | —       | 0.8   | 1,241   |     |
| 三和ホールディングス       | 80.4    | 91.1  | 414,778 |     |
| 文化シャッター          | 24      | 24.3  | 45,149  |     |
| 三協立山             | 10.7    | 11.3  | 7,898   |     |
| アルインコ            | 7.6     | 7.7   | 7,492   |     |
| LIXIL            | 130.3   | 136.1 | 231,778 |     |
| ノーリツ             | 13.8    | 15.2  | 25,961  |     |
| 長府製作所            | 8.4     | 9.6   | 18,201  |     |
| リンナイ             | 46.2    | 48.8  | 155,476 |     |
| 日東精工             | 13.7    | 13.7  | 8,452   |     |
| 岡部               | 16.5    | 16.3  | 12,844  |     |
| ジーテクト            | 9.3     | 10.8  | 17,031  |     |
| 東プレ              | 14.9    | 15.3  | 28,947  |     |
| 高周波熱錬            | 14      | 14.7  | 14,317  |     |
| 東京製鋼             | 5.7     | 5.8   | 7,197   |     |
| パイオラックス          | 11.6    | 12    | 29,304  |     |
| エイチワン            | 9.6     | 9.6   | 9,782   |     |
| 日本発条             | 75.1    | 80.9  | 140,766 |     |
| 中央発條             | 4       | 5.4   | 7,128   |     |
| 立川ブラインド工業        | 4.6     | 4.4   | 5,962   |     |
| 三益半導体工業          | 6.4     | —     | —       |     |
| <b>機械（5.5%）</b>  |         |       |         |     |
| 日本製鋼所            | 22.9    | 27.4  | 179,442 |     |
| 三浦工業             | 34.6    | 42.2  | 162,090 |     |
| タクマ              | 25.2    | 30.1  | 49,454  |     |
| ツガミ              | 18      | 19    | 25,897  |     |
| オークマ             | 8.1     | 15.6  | 49,218  |     |
| 芝浦機械             | 8.3     | 11.5  | 39,617  |     |
| アマダ              | 131.5   | 126.8 | 184,494 |     |
| アイダエンジニアリング      | 16.4    | 18.7  | 14,642  |     |
| FUJI             | 35.8    | 41.5  | 90,096  |     |
| 牧野フライス製作所        | 9.1     | 9.8   | 65,072  |     |
| オーエスジー           | 38.2    | 39.8  | 70,406  |     |
| 旭ダイヤモンド工業        | 23.1    | 21.2  | 17,087  |     |
| DMG森精機           | 50.2    | 56.9  | 146,432 |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄            | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|---------------|---------|-------|-----------|-----|
|               | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| ソディック         | 22.4    | 23.4  | 16,824    |     |
| ディスコ          | 40.1    | 43.5  | 1,797,855 |     |
| 日東工器          | 4.4     | 4.3   | 11,631    |     |
| 日進工具          | 7.1     | 7.1   | 5,254     |     |
| 富士ダイス         | —       | 6.7   | 5,179     |     |
| 豊和工業          | 5.5     | 5.5   | 6,022     |     |
| 石川製作所         | 3.1     | 3.1   | 4,340     |     |
| リケンNPR        | 7       | 10    | 24,000    |     |
| 島精機製作所        | 13.5    | 14.1  | 14,974    |     |
| オプトラン         | 13.7    | 14.5  | 26,926    |     |
| NCホールディングス    | 2       | —     | —         |     |
| イワキ           | 6.3     | 6.2   | 16,312    |     |
| フリュー          | 9.2     | 9.2   | 10,018    |     |
| ヤマシンフィルタ      | 21.8    | 22.4  | 13,417    |     |
| 日阪製作所         | 8.8     | 9.5   | 9,452     |     |
| やまびこ          | 13.3    | 14.4  | 36,201    |     |
| 野村マイクロ・サイエンス  | 2.8     | 13.5  | 23,719    |     |
| 平田機工          | 4       | 4.1   | 21,320    |     |
| PEGASUS       | 11      | 11    | 4,763     |     |
| マルマエ          | 4.3     | 4.3   | 6,841     |     |
| タツモ           | 5.2     | 6.6   | 16,909    |     |
| ナブテスコ         | 52.1    | 57.2  | 139,253   |     |
| 三井海洋開発        | 10.6    | 11.4  | 36,195    |     |
| レオン自動機        | 9.1     | 10.3  | 14,574    |     |
| S MC          | 25.2    | 26.9  | 1,737,471 |     |
| ホソカワミクロン      | 5.7     | 6.1   | 24,003    |     |
| ユニオンツール       | 3.6     | 3.9   | 20,748    |     |
| 瑞光            | 6.5     | 7.3   | 9,139     |     |
| オイレス工業        | 11.1    | 11.2  | 26,611    |     |
| 日精エー・エス・ビー機械  | 3.4     | 3.4   | 17,238    |     |
| サトーホールディングス   | 11.6    | 11.6  | 25,868    |     |
| 技研製作所         | 8.1     | 8.6   | 14,886    |     |
| 日本エアーテック      | 5.1     | 5.4   | 6,636     |     |
| 日精樹脂工業        | 6.9     | 7.1   | 6,461     |     |
| ワイエイシホールディングス | 2.7     | 4.2   | 8,038     |     |
| 小松製作所         | 390     | 445.3 | 1,810,589 |     |
| 住友重機械工業       | 48.9    | 53    | 172,197   |     |
| 日立建機          | 33      | 35.8  | 121,111   |     |
| 日工            | 12.8    | 11    | 7,777     |     |
| 巴工業           | 3.8     | 3.7   | 14,097    |     |
| 井関農機          | 8.4     | 9.9   | 9,365     |     |
| TOWA          | 8.4     | 29.7  | 47,133    |     |
| ローツェ          | 4.3     | 46.7  | 77,662    |     |
| クボタ           | 436.6   | 468.4 | 876,610   |     |

| 銘柄              | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|-----------------|---------|-------|-----------|-----|
|                 | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| 荏原実業            | 4.5     | 4.5   | 19,485    |     |
| 三菱化工機           | 2.9     | 3     | 9,600     |     |
| 月島ホールディングス      | 11.5    | 12.3  | 18,376    |     |
| 帝国電機製作所         | 5.9     | 6     | 16,560    |     |
| 新東工業            | 16.7    | 18.5  | 17,057    |     |
| 澁谷工業            | 8       | 8.3   | 32,328    |     |
| アイチ コーポレーション    | 11.8    | 14.7  | 20,315    |     |
| 小森コーポレーション      | 19.3    | 21.8  | 24,677    |     |
| 鶴見製作所           | 6.3     | 7.5   | 26,812    |     |
| 酒井重工業           | 1.4     | 2.8   | 6,638     |     |
| 荏原製作所           | 34      | 185.2 | 419,385   |     |
| 西島製作所           | 7.6     | 7.6   | 18,240    |     |
| 北越工業            | 8.7     | 9.3   | 15,707    |     |
| ダイキン工業          | 99.2    | 117.7 | 2,138,609 |     |
| オルガノ            | 11.5    | 13.7  | 121,382   |     |
| トーヨーカネツ         | 3.4     | 2.9   | 12,064    |     |
| 栗田工業            | 46.5    | 50.6  | 288,723   |     |
| 椿本チエイン          | 11.5    | 39.6  | 74,923    |     |
| 大同工業            | 6.3     | 3.6   | 2,653     |     |
| 木村化工機           | 8.7     | 8.7   | 8,404     |     |
| アネスト岩田          | 14.1    | 14.2  | 19,993    |     |
| ダイフク            | 134.8   | 152.6 | 491,524   |     |
| サムコ             | 2.3     | 2.3   | 6,566     |     |
| 加藤製作所           | 4.3     | 3.2   | 4,246     |     |
| タダノ             | 47.5    | 51.9  | 59,866    |     |
| フジテック           | 24.6    | 29.1  | 169,478   |     |
| CKD             | 23.9    | 24.7  | 61,404    |     |
| 平和              | 27.7    | 30.1  | 63,059    |     |
| 理想科学工業          | 7.2     | 7.4   | 25,530    |     |
| SANKYO          | 19.2    | 104.1 | 221,785   |     |
| 日本金銭機械          | 9.9     | 10.8  | 11,037    |     |
| マースグループホールディングス | 5.1     | 5.3   | 17,198    |     |
| フクシマガリレイ        | 6.1     | 6.7   | 36,850    |     |
| ダイコク電機          | 4.7     | 4.6   | 15,157    |     |
| 竹内製作所           | 15.1    | 16    | 77,600    |     |
| アマノ             | 23.6    | 26    | 112,112   |     |
| JUK I           | 13.7    | —     | —         |     |
| ジャノメ            | 9.4     | 9.4   | 10,114    |     |
| マックス            | 10.5    | 12.5  | 43,000    |     |
| グローリー           | 20.1    | 23.4  | 59,049    |     |
| 新晃工業            | 8.2     | 26.4  | 37,989    |     |
| 大和冷機工業          | 12.4    | 13.5  | 20,074    |     |
| セガサミーホールディングス   | 70.3    | 81    | 213,435   |     |
| TPR             | 9.3     | 10.5  | 24,475    |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                 | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|--------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                    | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| ツバキ・ナカシマ           | 19.1    | 21.7    | 11,370    |     |
| ホシザキ               | 49.7    | 58.4    | 359,393   |     |
| 大豊工業               | 8.3     | 9       | 5,499     |     |
| 日本精工               | 140     | 166.6   | 111,005   |     |
| NTN                | 163.4   | 209.8   | 50,268    |     |
| ジェイテクト             | 73.4    | 79.6    | 84,216    |     |
| 不二越                | 6.3     | 6.3     | 19,498    |     |
| 日本トムソン             | 20.6    | 23.6    | 11,469    |     |
| THK                | 47.8    | 52.3    | 192,568   |     |
| ユーシン精機             | 7.7     | 7.9     | 5,293     |     |
| 前澤給装工業             | 6.3     | 6.9     | 9,301     |     |
| イーグル工業             | 9.3     | 9.8     | 18,776    |     |
| 前澤工業               | 5.6     | 4.9     | 5,801     |     |
| PILLAR             | 7.8     | 8.1     | 35,599    |     |
| キッツ                | 30      | 29.5    | 32,774    |     |
| マキタ                | 97.9    | 112.6   | 529,220   |     |
| 三井E&S              | 40.7    | 47.9    | 72,903    |     |
| カナデビア              | 68.1    | 77.5    | 73,470    |     |
| 三菱重工業              | 145.3   | 1,579.3 | 3,547,107 |     |
| IHI                | 60      | 72.4    | 576,304   |     |
| スター精密              | 15.1    | 15.3    | 27,983    |     |
| <b>電気機器（17.4%）</b> |         |         |           |     |
| 日清紡ホールディングス        | 65.2    | 65.4    | 57,381    |     |
| イビデン               | 43.7    | 51.6    | 224,150   |     |
| ユニカミノルタ            | 186.2   | 200.8   | 132,829   |     |
| ブラザー工業             | 111.3   | 119.7   | 318,880   |     |
| ミネベアミツミ            | 144.4   | 156.4   | 386,151   |     |
| 日立製作所              | 400     | 2,324.1 | 9,170,898 |     |
| 三菱電機               | 916     | 917.5   | 2,356,598 |     |
| 富士電機               | 50.6    | 54.7    | 475,452   |     |
| 東洋電機製造             | 5       | 5       | 5,390     |     |
| 安川電機               | 91.5    | 97.8    | 387,581   |     |
| シンフォニアテクノロジー       | 10      | 10      | 58,500    |     |
| 明電舎                | 12.5    | 17.4    | 69,687    |     |
| オリジン               | 3.5     | 3.5     | 4,035     |     |
| 山洋電気               | 3.6     | 4.8     | 39,936    |     |
| デンヨー               | 6.9     | 7       | 19,236    |     |
| PHCホールディングス        | 11.6    | —       | —         |     |
| KOKUSAI ELECTRIC   | 32      | 63.1    | 157,750   |     |
| ソシオネクスト            | 12      | 89.5    | 221,870   |     |
| 東芝テック              | 11.3    | 13.3    | 48,345    |     |
| 芝浦メカトロニクス          | 4.5     | 6.2     | 48,298    |     |
| マブチモーター            | 20.7    | 42.1    | 93,630    |     |
| ニデック               | 183.9   | 398.7   | 1,095,826 |     |

| 銘柄               | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                  | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| トレックス・セミコンダクター   | 4.1     | 4.8     | 6,177     |     |
| 東光高岳             | 5.3     | 5.3     | 10,615    |     |
| ダブル・スコープ         | 24.1    | —       | —         |     |
| ダイヘン             | 7.4     | 9.9     | 69,795    |     |
| ヤーマン             | 15.2    | 17.7    | 13,558    |     |
| JVCケンウッド         | 67.7    | 70.9    | 106,279   |     |
| ミマキエンジニアリング      | 9       | 9       | 13,104    |     |
| I-PEX            | 6.2     | —       | —         |     |
| 大崎電気工業           | 21.5    | 21      | 16,065    |     |
| オムロン             | 63.9    | 82.7    | 392,080   |     |
| 日東工業             | 11.2    | 15.3    | 43,283    |     |
| IDEC             | 12.3    | 16.9    | 40,948    |     |
| ジーエス・ユアサコーポレーション | 27.3    | 39.5    | 102,186   |     |
| サクサ              | —       | 1.7     | 4,811     |     |
| メルコホールディングス      | 2.4     | —       | —         |     |
| 日本電気             | 110.1   | 127.6   | 1,666,456 |     |
| 富士通              | 76.6    | 828.3   | 2,371,422 |     |
| 沖電気工業            | 37.5    | 39.2    | 36,769    |     |
| 電気興業             | 3.7     | 3.7     | 6,204     |     |
| サンケン電気           | 7.7     | 9       | 56,700    |     |
| アイホン             | 4.9     | 4.9     | 13,274    |     |
| ルネサスエレクトロニクス     | 543     | 687.5   | 1,387,031 |     |
| セイコーエプソン         | 106.7   | 115     | 316,250   |     |
| ワコム              | 63.4    | 64.9    | 46,273    |     |
| アルバック            | 19.7    | 19.6    | 123,460   |     |
| アクセル             | 2.8     | 4.4     | 5,654     |     |
| EIZO             | 6.1     | 12.6    | 27,505    |     |
| 日本信号             | 19      | 19      | 17,347    |     |
| 京三製作所            | 19.5    | 19.5    | 10,315    |     |
| 能美防災             | 11.2    | 12.2    | 36,136    |     |
| ホーチキ             | 6.7     | 7.4     | 17,560    |     |
| エレコム             | 19.9    | 21.2    | 30,655    |     |
| パナソニックホールディングス   | 983.7   | 1,065.7 | 1,548,462 |     |
| シャープ             | 124.5   | 131.9   | 125,555   |     |
| アンリツ             | 59      | 62.6    | 72,584    |     |
| 富士通ゼネラル          | 23.8    | 25.6    | 52,556    |     |
| ソニーグループ          | 582.3   | 3,129   | 9,430,806 |     |
| TDK              | 131.7   | 779     | 1,565,400 |     |
| 帝国通信工業           | 4.1     | 4.1     | 12,152    |     |
| タムラ製作所           | 36.2    | 36.2    | 18,317    |     |
| アルプスアルパイン        | 74.6    | 78.1    | 120,234   |     |
| 日本電波工業           | 10.8    | 10.8    | 9,990     |     |
| 鈴木               | 5.5     | 5.3     | 10,319    |     |
| メイコー             | 9.1     | 8.9     | 82,770    |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                  | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| 日本トリム            | 2.2     | 2.2   | 8,085     |     |
| ローランド ディー. ジー.   | 4.6     | —     | —         |     |
| フォスター電機          | 8.7     | 8.4   | 12,104    |     |
| SMK              | 2.5     | 2.5   | 6,170     |     |
| ヨコオ              | 7.3     | 7.9   | 13,240    |     |
| ホシデン             | 19.3    | 24.6  | 58,129    |     |
| ヒロセ電機            | 12.7    | 13    | 234,585   |     |
| 日本航空電子工業         | 16.9    | 24.9  | 65,113    |     |
| TOA              | 10.1    | 10.1  | 9,281     |     |
| マクセル             | 17.4    | 23.4  | 40,435    |     |
| 古野電気             | 11.5    | 11.8  | 30,019    |     |
| スミダコーポレーション      | 11.3    | 11.5  | 11,293    |     |
| アイコム             | 3.6     | 3.6   | 9,633     |     |
| リオン              | 3.8     | 3.8   | 9,769     |     |
| 横河電機             | 91.1    | 98.3  | 335,694   |     |
| 新電元工業            | 3.4     | 3.4   | 8,180     |     |
| アズビル             | 57.6    | 245   | 298,410   |     |
| 東亜ディーケーケー        | 6       | 5.6   | 4,043     |     |
| 日本光電工業           | 36.7    | 79.6  | 167,438   |     |
| チノー              | 4       | 3.7   | 7,588     |     |
| 日本電子材料           | 6.2     | 6.5   | 13,572    |     |
| 堀場製作所            | 16.1    | 16.7  | 144,271   |     |
| アドバンテスト          | 236.3   | 281.5 | 2,370,511 |     |
| エスベック            | 7.1     | 7.1   | 18,594    |     |
| キーエンス            | 82.4    | 89.4  | 5,834,244 |     |
| 日置電機             | 4.1     | 4.6   | 34,822    |     |
| シスメックス           | 71      | 231.3 | 728,363   |     |
| 日本マイクロニクス        | 14.8    | 15.6  | 59,358    |     |
| メガチップス           | 6.8     | 6.8   | 41,956    |     |
| OBARA GROUP      | 4.9     | 5.9   | 24,514    |     |
| コーセル             | 10.6    | 9.8   | 11,720    |     |
| イリソ電子工業          | 7.6     | 7.8   | 20,615    |     |
| オブテックスグループ       | 15.1    | 21.6  | 41,731    |     |
| 千代田インテグレ         | 3.7     | 3.8   | 13,623    |     |
| レーザーテック          | 37.8    | 40.9  | 666,874   |     |
| スタンレー電気          | 56.5    | 56    | 142,184   |     |
| ウシオ電機            | 41.8    | 42.3  | 86,270    |     |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 6.3     | —     | —         |     |
| 日本セラミック          | 8       | 10    | 26,310    |     |
| 遠藤照明             | —       | 3.2   | 4,518     |     |
| 古河電池             | 6.5     | —     | —         |     |
| 山一電機             | 7.3     | 7.7   | 17,740    |     |
| 図研               | 7.2     | 7.8   | 34,086    |     |
| 日本電子             | 20.6    | 22    | 115,940   |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |         | 期末         |     |
|---------------------|---------|---------|------------|-----|
|                     | 株数      | 株数      | 評価額        | 評価額 |
| カシオ計算機              | 61.3    | 69.5    | 80,098     |     |
| ファナック               | 402.1   | 432.4   | 1,699,332  |     |
| 日本シイエムケイ            | 19.8    | 19.8    | 8,157      |     |
| エンブラス               | 2.5     | 2.6     | 13,598     |     |
| 大真空                 | 10.8    | 13.3    | 6,995      |     |
| ローム                 | 152.4   | 160.7   | 226,988    |     |
| 浜松ホトニクス             | 66      | 142.7   | 260,284    |     |
| 三井ハイテック             | 7.4     | 39.4    | 30,338     |     |
| 新光電気工業              | 29.1    | 29.1    | 153,560    |     |
| 京セラ                 | 128     | 554.1   | 823,392    |     |
| 太陽誘電                | 40.1    | 42      | 91,161     |     |
| 村田製作所               | 749.7   | 798     | 1,990,611  |     |
| 双葉電子工業              | 17.4    | 17.4    | 7,969      |     |
| 北陸電気工業              | 3.2     | 3.2     | 5,008      |     |
| ニチコン                | 16.8    | 21.2    | 22,090     |     |
| KOA                 | 12.6    | 13.3    | 12,940     |     |
| 市光工業                | 15.9    | 15.9    | 6,391      |     |
| 小糸製作所               | 92.2    | 92.1    | 178,996    |     |
| ミツバ                 | 16.2    | 16.2    | 13,753     |     |
| SCREENホールディングス      | 28.2    | 37.2    | 363,964    |     |
| キャノン電子              | 9.1     | 9.1     | 22,549     |     |
| キャノン                | 411.3   | 445.8   | 2,186,203  |     |
| リコー                 | 206.9   | 234.7   | 408,025    |     |
| 象印マホービン             | 23.5    | 32      | 49,088     |     |
| 東京エレクトロン            | 174.3   | 189.2   | 4,472,688  |     |
| イノテック               | 6.1     | 6.5     | 9,002      |     |
| <b>輸送用機器 (7.0%)</b> |         |         |            |     |
| トヨタ紡織               | 34.5    | 36.5    | 70,007     |     |
| ユニブレス               | 15.1    | 15.7    | 15,213     |     |
| 豊田自動織機              | 68.4    | 75.8    | 853,129    |     |
| モリタホールディングス         | 14.6    | 15.9    | 33,994     |     |
| 三櫻工業                | 14      | 13      | 9,464      |     |
| デンソー                | 679.6   | 952.3   | 2,064,110  |     |
| 東海理化電機製作所           | 22.7    | 25.1    | 52,433     |     |
| 川崎重工業               | 64      | 66.5    | 371,602    |     |
| 名村造船所               | 16      | 26.5    | 40,757     |     |
| 日本車輛製造              | 5       | 3.3     | 7,405      |     |
| 三菱ロジスネクスト           | 14      | 15.2    | 17,556     |     |
| 日産自動車               | 1,171.2 | 1,142.6 | 411,793    |     |
| いすゞ自動車              | 239.1   | 278.4   | 564,456    |     |
| トヨタ自動車              | 4,527   | 4,750   | 12,402,250 |     |
| 日野自動車               | 106.9   | —       | —          |     |
| 三菱自動車工業             | 322.3   | 345.8   | 136,072    |     |
| GMB                 | 2       | —       | —          |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                 | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|--------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                    | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| 武蔵精密工業             | 19.8    | 22.3    | 74,482    |     |
| 日産車体               | 16      | 9.8     | 10,887    |     |
| 新明和工業              | 25.9    | 25.9    | 33,644    |     |
| 極東開発工業             | 13.3    | 14.9    | 34,299    |     |
| トピー工業              | 7.1     | 7.1     | 13,532    |     |
| ティラド               | 3       | 2.4     | 8,160     |     |
| タチエス               | 13.2    | 16.3    | 27,775    |     |
| NOK                | 32.2    | 34.7    | 78,248    |     |
| フタバ産業              | 24      | 23.9    | 15,869    |     |
| カヤバ                | 7.8     | 16.2    | 40,095    |     |
| 大同メタル工業            | 19.5    | 19.5    | 9,262     |     |
| プレス工業              | 36.2    | 36.2    | 19,186    |     |
| ミクニ                | 10      | —       | —         |     |
| 太平洋工業              | 18.4    | 19.1    | 24,772    |     |
| アイシン               | 63.5    | 189     | 301,644   |     |
| マツダ                | 272.5   | 271.7   | 263,956   |     |
| 今仙電機製作所            | 6.3     | 6.3     | 3,137     |     |
| 本田技研工業             | 2,010   | 2,124.9 | 2,766,619 |     |
| スズキ                | 151.4   | 728.1   | 1,183,890 |     |
| SUBARU             | 260.9   | 273.1   | 674,693   |     |
| 安永                 | 4.4     | 4.4     | 2,160     |     |
| ヤマハ発動機             | 118.5   | 379.8   | 498,297   |     |
| エクセディ              | 13      | 14.1    | 62,886    |     |
| 豊田合成               | 23.8    | 24.5    | 60,772    |     |
| 愛三工業               | 14      | 14.5    | 19,314    |     |
| 日本プラスト             | 11      | 10.5    | 3,612     |     |
| ヨロズ                | 10      | 9.5     | 10,963    |     |
| エフ・シー・シー           | 14.2    | 18.8    | 56,362    |     |
| シマノ                | 33.5    | 38.5    | 825,825   |     |
| テイ・エス テック          | 37.5    | 36.7    | 60,848    |     |
| ジャムコ               | 4       | 7.9     | 10,909    |     |
| <b>精密機器 (2.4%)</b> |         |         |           |     |
| リガク・ホールディングス       | —       | 48.3    | 51,246    |     |
| テルモ                | 232.8   | 597.2   | 1,832,209 |     |
| 日機装                | 19.1    | 19.9    | 18,964    |     |
| 日本エム・ディ・エム         | 5.4     | 6.7     | 4,093     |     |
| 島津製作所              | 102.2   | 128.8   | 545,210   |     |
| 長野計器               | 6.2     | 6.5     | 15,665    |     |
| ブイ・テクノロジー          | 4.4     | 4.7     | 10,424    |     |
| 東京計器               | 6.9     | 6.9     | 22,873    |     |
| 愛知時計電機             | 3.8     | 3.8     | 7,516     |     |
| インターアクション          | 4.5     | 5.5     | 5,483     |     |
| オーバル               | 7.3     | 7.3     | 2,671     |     |
| 東京精密               | 17.8    | 18.2    | 131,859   |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|---------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                     | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| マニー                 | 33.2    | 36    | 62,316    |     |
| ニコン                 | 119.2   | 140.8 | 250,905   |     |
| トプコン                | 43.5    | 50.8  | 81,407    |     |
| オリンパス               | 507.6   | 512.1 | 1,200,362 |     |
| 理研計器                | 5.1     | 12.7  | 47,688    |     |
| タムロン                | 5.4     | 12    | 51,420    |     |
| H O Y A             | 164     | 174.3 | 3,403,207 |     |
| ノーリツ鋼機              | 7.9     | 8.2   | 35,752    |     |
| A&Dホロンホールディングス      | 11.9    | 12.5  | 23,937    |     |
| 朝日インテック             | 92.1    | 109.3 | 285,163   |     |
| シチズン時計              | 78.1    | 78.6  | 69,639    |     |
| リズム                 | 1.7     | 1.3   | 4,849     |     |
| メニコン                | 28.4    | 33    | 50,160    |     |
| 松風                  | 4       | 8.4   | 17,035    |     |
| セイコーグループ            | 12.8    | 13.6  | 56,984    |     |
| ニプロ                 | 69      | 75.4  | 103,976   |     |
| <b>その他製品 (2.6%)</b> |         |       |           |     |
| 三井松島ホールディングス        | 5.5     | 7.5   | 25,762    |     |
| スノーピーク              | 12.3    | —     | —         |     |
| パラマウントベッドホールディングス   | 18.9    | 20.2  | 51,126    |     |
| トランザクション            | 5.2     | 6.2   | 13,900    |     |
| ニホンフラッシュ            | 8.6     | 8.6   | 7,138     |     |
| 前田工織                | 7       | 15.4  | 27,720    |     |
| 永大産業                | 17.8    | 17.8  | 3,720     |     |
| アートネイチャー            | 9.8     | 9.8   | 7,947     |     |
| フルヤ金属               | —       | 8.4   | 28,854    |     |
| バンドダイナムコホールディングス    | 225.4   | 241.9 | 769,000   |     |
| S H O E I           | 18.7    | 24.8  | 59,420    |     |
| フランスベッドホールディングス     | 10.5    | 11.9  | 14,863    |     |
| パイロットコーポレーション       | 12.4    | 14.1  | 67,539    |     |
| 萩原工業                | 6.3     | 6.3   | 8,637     |     |
| フジシールインターナショナル      | 16.7    | 19.9  | 49,829    |     |
| タカラトミー              | 37.5    | 38.3  | 161,817   |     |
| 広済堂ホールディングス         | 18      | 33.6  | 19,219    |     |
| プロネクス               | 7.7     | 8.6   | 10,715    |     |
| T O P P A Nホールディングス | 101.2   | 117.3 | 473,188   |     |
| 大日本印刷               | 90.2    | 186   | 418,686   |     |
| 共同印刷                | 2.8     | 2.8   | 11,354    |     |
| N I S S H A         | 15.1    | 15.1  | 24,597    |     |
| TAKARA & COMPANY    | 5.7     | 5.3   | 14,389    |     |
| アシックス               | 70.2    | 329.9 | 1,033,906 |     |
| ツツミ                 | 2       | 3.2   | 6,662     |     |
| ローランド               | 6.2     | 6.6   | 25,146    |     |
| 小松ウオール工業            | 3.3     | 6.6   | 9,919     |     |



国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                  | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|---------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                     | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| ヤマハ                 | 51.9    | 164.1 | 181,330   |     |
| 河合楽器製作所             | 2.4     | 2.9   | 8,296     |     |
| クリナップ               | 10.5    | 9.8   | 6,742     |     |
| ビジョン                | 53      | 57.5  | 84,927    |     |
| キングジム               | 9       | 9.3   | 7,886     |     |
| リンテック               | 16.3    | 17.5  | 52,850    |     |
| イトーキ                | 17.1    | 17.8  | 27,981    |     |
| 任天堂                 | 519.9   | 563.3 | 4,988,021 |     |
| 三菱鉛筆                | 11.8    | 12.4  | 29,760    |     |
| タカラスタンダード           | 15.2    | 19.3  | 31,555    |     |
| コクヨ                 | 36.5    | 44.7  | 126,277   |     |
| グローブライド             | 6.8     | 7.9   | 15,010    |     |
| オカムラ                | 24.9    | 26.3  | 51,548    |     |
| 美津濃                 | 8.3     | 8.8   | 73,744    |     |
| <b>電気・ガス業（1.3%）</b> |         |       |           |     |
| グリムス                | 3.8     | 4.1   | 10,992    |     |
| 東京電力ホールディングス        | 744.2   | 750.7 | 407,104   |     |
| 中部電力                | 303     | 327.8 | 528,085   |     |
| 関西電力                | 318.1   | 376.5 | 751,305   |     |
| 中国電力                | 143.2   | 153.4 | 147,463   |     |
| 北陸電力                | 83.4    | 90.1  | 81,486    |     |
| 東北電力                | 216.3   | 234.6 | 294,657   |     |
| 四国電力                | 75.3    | 81.7  | 102,533   |     |
| 九州電力                | 189.6   | 205.3 | 314,006   |     |
| 北海道電力               | 79.5    | 91.6  | 80,040    |     |
| 沖縄電力                | 20.6    | 22.3  | 21,318    |     |
| 電源開発                | 67.5    | 67.1  | 169,259   |     |
| エフオン                | 8.6     | 9.9   | 4,049     |     |
| イーレックス              | 15.1    | 32.2  | 20,157    |     |
| レノバ                 | 22.2    | 24.8  | 19,492    |     |
| 東京瓦斯                | 174.2   | 169   | 764,049   |     |
| 大阪瓦斯                | 166.7   | 175.6 | 578,953   |     |
| 東邦瓦斯                | 34.6    | 35.3  | 134,634   |     |
| 北海道瓦斯               | 5.1     | 25.5  | 13,770    |     |
| 広島ガス                | 19.1    | 21.3  | 7,987     |     |
| 西部ガスホールディングス        | 7.8     | 9.5   | 16,482    |     |
| 静岡ガス                | 18      | 19.4  | 19,729    |     |
| メタウォーター             | 9.8     | 11.8  | 21,122    |     |
| <b>陸運業（2.3%）</b>    |         |       |           |     |
| SBSホールディングス         | 7.2     | 9     | 22,248    |     |
| 東武鉄道                | 90.4    | 94.9  | 244,082   |     |
| 相鉄ホールディングス          | 27.3    | 32.2  | 78,696    |     |
| 東急                  | 230.7   | 251.4 | 433,790   |     |
| 京浜急行電鉄              | 93.4    | 110.4 | 147,936   |     |

| 銘柄                     | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|------------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                        | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| 小田急電鉄                  | 126.1   | 147.5 | 233,713   |     |
| 京王電鉄                   | 43.6    | 47.4  | 185,618   |     |
| 京成電鉄                   | 53.1    | 51.8  | 234,291   |     |
| 富士急行                   | 10.2    | 12.1  | 27,830    |     |
| 東日本旅客鉄道                | 147.9   | 489.7 | 1,437,514 |     |
| 西日本旅客鉄道                | 102.3   | 224.9 | 639,165   |     |
| 東海旅客鉄道                 | 317.5   | 341.4 | 1,057,998 |     |
| 東京地下鉄                  | —       | 153.6 | 257,664   |     |
| 西武ホールディングス             | 99.9    | 97.7  | 297,203   |     |
| 鴻池運輸                   | 14      | 16.8  | 50,400    |     |
| 西日本鉄道                  | 21.6    | 24.6  | 56,026    |     |
| ハマキョウレックス              | 6.3     | 28.8  | 37,238    |     |
| サカイ引越センター              | 7.8     | 11    | 26,059    |     |
| 近鉄グループホールディングス         | 82.1    | 95.7  | 303,751   |     |
| 阪急阪神ホールディングス           | 109.5   | 119.1 | 494,265   |     |
| 南海電気鉄道                 | 39.3    | 39.9  | 96,777    |     |
| 京阪ホールディングス             | 45.4    | 49.3  | 169,493   |     |
| 神戸電鉄                   | 2.8     | 1.7   | 4,012     |     |
| 名古屋鉄道                  | 90.8    | 97.7  | 169,265   |     |
| 山陽電気鉄道                 | 6.7     | 6.5   | 13,130    |     |
| アルプス物流                 | 6.7     | —     | —         |     |
| ヤマトホールディングス            | 105.4   | 108.8 | 186,320   |     |
| 山九                     | 20.9    | 21.5  | 111,026   |     |
| 丸全昭和運輸                 | 5       | 5.9   | 38,291    |     |
| センコーグループホールディングス       | 42.9    | 50.9  | 76,502    |     |
| トナミホールディングス            | 1.9     | 2     | 10,880    |     |
| ニッコンホールディングス           | 26.1    | 52.1  | 103,991   |     |
| 福山通運                   | 6.2     | 9.8   | 37,191    |     |
| セイノーホールディングス           | 47.1    | 44.4  | 108,780   |     |
| 神奈川中央交通                | 2.6     | 2.5   | 9,500     |     |
| AZ-COM丸和ホールディングス       | 20      | 28.3  | 28,526    |     |
| C&Fロジホールディングス          | 8.3     | —     | —         |     |
| 九州旅客鉄道                 | 58.1    | 68.2  | 270,140   |     |
| SGホールディングス             | 145.5   | 150.2 | 219,667   |     |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 28.3    | 31.8  | 245,750   |     |
| <b>海運業（0.6%）</b>       |         |       |           |     |
| 日本郵船                   | 233.4   | 184.5 | 892,057   |     |
| 商船三井                   | 178.5   | 168.9 | 870,341   |     |
| 川崎汽船                   | 69.4    | 203   | 408,436   |     |
| N Sユナイテッド海運            | 4.6     | 6.2   | 25,017    |     |
| 明海グループ                 | 7.4     | 1.8   | 1,191     |     |
| 飯野海運                   | 30.6    | 34.7  | 38,690    |     |
| 乾汽船                    | 11.6    | 12.6  | 19,454    |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 期末      |     |
|------------------|---------|-------|---------|-----|
|                  | 株数      | 株数    | 評価額     | 評価額 |
| 空運業 (0.4%)       |         |       |         |     |
| 日本航空             | 201.9   | 205.6 | 518,009 |     |
| ANAホールディングス      | 224.6   | 243   | 710,532 |     |
| 倉庫・運輸関連業 (0.1%)  |         |       |         |     |
| トランコム            | 2.4     | —     | —       |     |
| 日新               | 6.5     | 6.7   | 29,212  |     |
| 三菱倉庫             | 20      | 102.5 | 113,160 |     |
| 三井倉庫ホールディングス     | 7.5     | 9.8   | 73,598  |     |
| 住友倉庫             | 21.5    | 24.2  | 65,993  |     |
| 滋澤倉庫             | 3.3     | 3.3   | 10,164  |     |
| 東陽倉庫             | 3.7     | 3.7   | 5,431   |     |
| 日本トランスシティ        | 16.8    | 17.9  | 18,544  |     |
| 川西倉庫             | 5.2     | 5.2   | 5,454   |     |
| 安田倉庫             | 6.5     | 6.6   | 11,464  |     |
| 上組               | 39      | 40.6  | 136,903 |     |
| キムラユニティー         | 4.3     | 4     | 5,780   |     |
| キューソー流通システム      | 6.3     | 6.7   | 16,173  |     |
| エーアイティー          | 5.4     | 5.4   | 9,396   |     |
| 内外トランスライン        | 3.5     | 3.5   | 9,814   |     |
| 日本コンセプト          | 3.3     | 3.3   | 5,923   |     |
| 情報・通信業 (7.6%)    |         |       |         |     |
| NECネットエスアイ       | 27.3    | —     | —       |     |
| クロスキャット          | 5.2     | 7.1   | 7,547   |     |
| システナ             | 138.2   | 134.9 | 48,024  |     |
| デジタルアーツ          | 5.2     | 7.3   | 43,216  |     |
| 日鉄ソリューションズ       | 14      | 30.8  | 126,742 |     |
| キューブシステム         | 5.6     | 3.5   | 3,636   |     |
| コア               | 4.4     | 3.3   | 5,982   |     |
| 手間いらず            | 1.5     | 1.9   | 6,555   |     |
| ラクーンホールディングス     | 8.1     | 8.1   | 5,589   |     |
| ソリトンシステムズ        | 4.8     | 4.8   | 5,558   |     |
| ソフトクリエイトホールディングス | 7.1     | 7.1   | 15,811  |     |
| T I S            | 90.4    | 94.9  | 350,181 |     |
| グリー              | 23.3    | 30.5  | 13,054  |     |
| コーエーテックモホールディングス | 51.8    | 68.8  | 121,122 |     |
| 三菱総合研究所          | 3.9     | 3.9   | 17,043  |     |
| ファインデックス         | 8.2     | 7.9   | 6,169   |     |
| ブレインパッド          | 6.6     | 7.5   | 7,620   |     |
| K L a b          | 18.4    | —     | —       |     |
| ポルトゥウィンホールディングス  | 15      | 15    | 6,990   |     |
| ネクソン             | 184.5   | 197.4 | 416,810 |     |
| アイスタイル           | 26.4    | 29.9  | 12,617  |     |
| エムアップホールディングス    | 10.8    | 11.1  | 18,015  |     |
| エイチーム            | 6.7     | 6.7   | 4,401   |     |

| 銘柄                   | 期首(前期末) |      | 期末      |     |
|----------------------|---------|------|---------|-----|
|                      | 株数      | 株数   | 評価額     | 評価額 |
| セルシス                 | —       | 20   | 27,380  |     |
| エニグモ                 | 12.7    | 12.7 | 3,860   |     |
| コロブラ                 | 31.5    | 32   | 14,816  |     |
| ブロードリーフ              | 42.9    | 43.9 | 30,554  |     |
| クロス・マーケティンググループ      | 5       | —    | —       |     |
| デジタルハーツホールディングス      | 5.7     | 5.7  | 4,611   |     |
| メディアドゥ               | 3.7     | 4.3  | 5,731   |     |
| じげん                  | 24.9    | 25.5 | 13,336  |     |
| フィックスターズ             | 9.8     | 9.8  | 15,934  |     |
| CARTA HOLDINGS       | 4.4     | 5    | 7,375   |     |
| オプティム                | 7.2     | 22.5 | 16,200  |     |
| セレス                  | 3.8     | 4    | 9,824   |     |
| S H I F T            | 5.5     | 6.2  | 108,097 |     |
| ティーガイア               | 9       | —    | —       |     |
| セック                  | —       | 1.3  | 5,395   |     |
| テクマトリックス             | 15.2    | 22.8 | 55,654  |     |
| プロシップ                | 4.3     | 3.9  | 6,002   |     |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 22      | 22.8 | 68,035  |     |
| GMOペイメントゲートウェイ       | 16.5    | 20.6 | 163,275 |     |
| システムリサーチ             | 2.8     | 5.6  | 7,716   |     |
| インターネットイニシアティブ       | 41.6    | 52.1 | 159,478 |     |
| さくらインターネット           | 9.6     | 14.6 | 66,065  |     |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 2.7     | 2.8  | 6,994   |     |
| S R Aホールディングス        | 4.4     | 5.2  | 22,516  |     |
| 朝日ネット                | 9.6     | 5.6  | 3,500   |     |
| e B A S E            | 12.2    | 12.2 | 8,308   |     |
| アバントグループ             | 10.7    | 15.7 | 31,509  |     |
| アドソル日進               | 3.8     | 3.5  | 7,455   |     |
| フリービット               | 5.1     | 4.6  | 6,486   |     |
| コムチュア                | 11      | 12.3 | 26,887  |     |
| アイル                  | 4       | 5.4  | 17,658  |     |
| マークラインズ              | 4.7     | 5.2  | 12,506  |     |
| メディカル・データ・ビジョン       | 12.6    | 12.6 | 5,594   |     |
| g u m i              | 13.1    | —    | —       |     |
| テラスカイ                | 3.9     | 4.3  | 8,492   |     |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジ | 5.2     | 4.7  | 10,213  |     |
| ネオジャパン               | —       | 3.2  | 6,000   |     |
| P R T I M E S        | 2.7     | 2.2  | 3,515   |     |
| ラクス                  | 39      | 47.2 | 97,656  |     |
| ダブルスタンダード            | 3.7     | 3.4  | 5,691   |     |
| オープンドア               | 6.3     | 6.3  | 4,353   |     |
| アカツキ                 | 4.4     | 4.5  | 11,016  |     |
| U b i c o mホールディングス  | 3.1     | 3.1  | 3,971   |     |
| カナミックネットワーク          | 12.6    | 12.2 | 6,014   |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                     | 期首(前期末) |         | 期末      |     |
|------------------------|---------|---------|---------|-----|
|                        | 株数      | 株数      | 評価額     | 評価額 |
| チェンジホールディングス           | 19.6    | 28.6    | 38,324  |     |
| シンクロ・フード               | —       | 2.3     | 963     |     |
| オークネット                 | 4.5     | 4.2     | 11,285  |     |
| セグエグループ                | —       | 4.5     | 2,826   |     |
| マクロミル                  | 17      | —       | —       |     |
| オロ                     | 3.7     | 3.8     | 9,074   |     |
| ユーザーローカル               | 3.2     | 3.8     | 7,676   |     |
| PKSHA Technology       | —       | 8.5     | 35,020  |     |
| マネーフォワード               | 18.5    | 22.8    | 112,312 |     |
| SUN ASTERISK           | 6.2     | 6.6     | 4,692   |     |
| プラスアルファ・コンサルティング       | 4.9     | 11.3    | 19,876  |     |
| 電算システムホールディングス         | 4.2     | 4.2     | 10,353  |     |
| APPIER GROUP           | 28.4    | 30.1    | 43,283  |     |
| ビジョナル                  | —       | 10.7    | 84,358  |     |
| 野村総合研究所                | 177.3   | 194.8   | 890,236 |     |
| 日本システム技術               | 2.8     | 8.4     | 16,136  |     |
| インテージホールディングス          | 9.5     | 10.2    | 16,595  |     |
| 東邦システムサイエンス            | —       | 3.8     | 5,449   |     |
| インフォコム                 | 10.6    | —       | —       |     |
| シンプレクス・ホールディングス        | 13.5    | 17.5    | 43,890  |     |
| HEROZ                  | 3       | 4.1     | 4,157   |     |
| ラクスル                   | 20.1    | 29      | 32,596  |     |
| メルカリ                   | 50.1    | 48      | 92,424  |     |
| I P S                  | 3       | 2.9     | 7,705   |     |
| システムサポート               | 3.4     | 3.3     | 5,973   |     |
| イーソル                   | 7.5     | 7.5     | 4,837   |     |
| ウイングアーク1st             | 8.7     | 9.5     | 32,300  |     |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス | 2.6     | —       | —       |     |
| サーバーワークス               | 1.9     | 2.1     | 4,863   |     |
| Sansan                 | 27.3    | 34.1    | 72,803  |     |
| ギフトティ                  | 7.6     | 8       | 11,160  |     |
| メドレー                   | 11.1    | 11.9    | 52,003  |     |
| ベース                    | 3.1     | 4.4     | 14,344  |     |
| JMDC                   | 13.7    | 12.8    | 53,120  |     |
| フォーカスシステムズ             | 6.8     | 6       | 6,582   |     |
| クレスコ                   | 7       | 14      | 17,360  |     |
| フジ・メディア・ホールディングス       | 79.5    | 86      | 148,995 |     |
| オービック                  | 27.6    | 166.9   | 823,985 |     |
| ジャストシステム               | 11.9    | 15.6    | 54,600  |     |
| TDCソフト                 | 7.2     | 16.8    | 22,176  |     |
| LINEヤフー                | 1,160   | 1,428.9 | 597,708 |     |
| トレンドマイクロ               | 39.1    | 47.3    | 393,299 |     |
| IDホールディングス             | 6.1     | 5.9     | 9,652   |     |

| 銘柄                | 期首(前期末) |          | 期末        |     |
|-------------------|---------|----------|-----------|-----|
|                   | 株数      | 株数       | 評価額       | 評価額 |
| 日本オラクル            | 15.9    | 17.8     | 271,450   |     |
| アルファシステムズ         | 3       | 2.5      | 8,650     |     |
| フューチャー            | 18.5    | 26.8     | 50,866    |     |
| CAC Holdings      | 5.3     | 4.3      | 7,464     |     |
| S Bテクノロジー         | 3.7     | —        | —         |     |
| オービックビジネスコンサルタント  | 12.3    | 16.4     | 117,719   |     |
| アイティフォー           | 11.5    | 10.9     | 15,260    |     |
| 東計電算              | 1.4     | 2.8      | 12,152    |     |
| 大塚商会              | 40.8    | 101.9    | 383,449   |     |
| サイボウズ             | 11.6    | 12.7     | 27,228    |     |
| 電通総研              | 10      | 10       | 54,000    |     |
| ACCESS            | 10.4    | 10.4     | 9,848     |     |
| デジタルガレージ          | 14.7    | 16.8     | 63,420    |     |
| イーエムシステムズ         | 14.5    | 28.5     | 20,634    |     |
| ウェザーニューズ          | 2.5     | 5.4      | 15,643    |     |
| C I J             | 14.7    | 23.4     | 10,483    |     |
| ビジネスエンジニアリング      | 1.5     | 2        | 7,710     |     |
| WOWOW             | 7       | 7        | 6,951     |     |
| スカラ               | 8.7     | 3.5      | 1,550     |     |
| ANYCOLOR          | 3       | 12.7     | 26,568    |     |
| IMAGICA GROUP     | 8       | 8.7      | 4,384     |     |
| ネットワンシステムズ        | 30.9    | —        | —         |     |
| システムソフト           | —       | 27.4     | 1,589     |     |
| アルゴグラフィックス        | 7.5     | 8.2      | 42,886    |     |
| マーベラス             | 14.2    | 14.2     | 8,122     |     |
| エイベックス            | 14.2    | 23.2     | 35,008    |     |
| B I P R O G Y     | 27      | 31.2     | 144,456   |     |
| 都築電気              | 4.5     | 4.5      | 11,088    |     |
| T B Sホールディングス     | 42.3    | 47.6     | 181,832   |     |
| 日本テレビホールディングス     | 72.9    | 83.5     | 208,750   |     |
| 朝日放送グループホールディングス  | 9.6     | 9.6      | 5,913     |     |
| テレビ朝日ホールディングス     | 19.9    | 20.8     | 46,030    |     |
| スカパーJ SATホールディングス | 73.7    | 67.9     | 60,159    |     |
| テレビ東京ホールディングス     | 6       | 6        | 18,270    |     |
| 日本BS放送            | 6.5     | 3.5      | 3,104     |     |
| ビジョン              | 12.6    | 13.4     | 19,028    |     |
| U-NEXT HOLDINGS   | 9.3     | 30.3     | 50,328    |     |
| 日本通信              | 78.5    | 91.4     | 12,613    |     |
| 日本電信電話            | 24,550  | 26,687.6 | 4,141,915 |     |
| KDDI              | 637     | 660.9    | 3,276,081 |     |
| ソフトバンク            | 1,326   | 14,372.3 | 2,802,598 |     |
| 光通信               | 8.9     | 10.4     | 343,824   |     |
| エムティーアイ           | 8.2     | 7.4      | 9,472     |     |
| GMOインターネットグループ    | 30.6    | 31.7     | 82,610    |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                   | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|----------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                      | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| ファイバークート             | 5       | 5     | 4,685     |     |
| KADOKAWA             | 43.6    | 49.1  | 215,254   |     |
| 学研ホールディングス           | 14.4    | 14.6  | 14,979    |     |
| ゼンリン                 | 14.5    | 14.5  | 11,745    |     |
| アイネット                | 5.7     | 5.6   | 9,044     |     |
| 松竹                   | 4.7     | 5.9   | 63,130    |     |
| 東宝                   | 46      | 56.4  | 368,574   |     |
| 東映                   | 2.3     | 15.5  | 97,650    |     |
| NTTデータグループ           | 222.5   | 235   | 676,682   |     |
| ビー・シー・イー             | 5.2     | 5.7   | 12,209    |     |
| ビジネスブレイン太田昭和         | 3.9     | 3.3   | 6,913     |     |
| DTS                  | 17.2    | 17.9  | 75,896    |     |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 39.2    | 46.1  | 278,444   |     |
| シーイーシー               | 11.7    | 11.7  | 23,891    |     |
| カブコン                 | 74.5    | 180.5 | 633,555   |     |
| アイ・エス・ビー             | 4.6     | 4.6   | 6,384     |     |
| ジャステック               | 5.5     | —     | —         |     |
| SCSK                 | 58      | 74.8  | 227,616   |     |
| NSW                  | 3.3     | 3.3   | 10,164    |     |
| アイネス                 | 6.3     | 6.7   | 11,597    |     |
| TKC                  | 12.7    | 18.4  | 71,300    |     |
| 富士ソフト                | 17.2    | 24.1  | 230,588   |     |
| NSD                  | 29      | 36.7  | 125,881   |     |
| コナミグループ              | 32.1    | 33.9  | 507,144   |     |
| 福井コンピュータホールディングス     | 6.5     | 5.2   | 15,085    |     |
| JBCホールディングス          | 6.2     | 5.9   | 27,848    |     |
| ミロク情報サービス            | 7.9     | 7.9   | 15,310    |     |
| ソフトバンクグループ           | 406     | 442.2 | 3,938,233 |     |
| <b>卸売業（6.8%）</b>     |         |       |           |     |
| リョーサン菱洋ホールディングス      | —       | 17.3  | 39,374    |     |
| 高千穂交易                | 2.7     | 3.5   | 13,352    |     |
| 伊藤忠食品                | 2       | 2.3   | 16,054    |     |
| エレマテック               | 8       | —     | —         |     |
| あらた                  | 6.6     | 14.1  | 42,864    |     |
| トーメンデバイス             | 1.4     | 1.4   | 9,352     |     |
| 東京エレクトロン デバイス        | 9.6     | 9.4   | 29,234    |     |
| 円谷フィールズホールディングス      | 15.1    | 16.8  | 36,876    |     |
| 双日                   | 96.4    | 103.7 | 319,810   |     |
| アルフレッサ ホールディングス      | 87.6    | 90.1  | 197,273   |     |
| 横浜冷凍                 | 24.3    | 24.3  | 19,537    |     |
| ラサ商事                 | 5       | 5     | 6,740     |     |
| アルコニックス              | 12      | 12    | 17,688    |     |
| 神戸物産                 | 67.5    | 72.9  | 270,313   |     |
| あい ホールディングス          | 13.8    | 15    | 31,470    |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |       | 期末      |     |
|---------------------|---------|-------|---------|-----|
|                     | 株数      | 株数    | 評価額     | 評価額 |
| ダイワボウホールディングス       | 36.8    | 41.5  | 127,986 |     |
| マクニカホールディングス        | 20.6    | 76.1  | 135,762 |     |
| ラクト・ジャパン            | 3.8     | 4     | 11,612  |     |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 13.4    | 14.7  | 18,125  |     |
| 八洲電機                | 7.7     | 7.5   | 11,932  |     |
| メディアスホールディングス       | 7       | 7     | 5,495   |     |
| レスター                | 8       | 8     | 19,040  |     |
| ジオリーブグループ           | 3       | 1.6   | 1,681   |     |
| 大光                  | 8.9     | —     | —       |     |
| TOKAIホールディングス       | 42.3    | 46.9  | 43,054  |     |
| 三洋貿易                | 10.1    | 9.9   | 15,147  |     |
| ビューティガレージ           | 3       | 3.3   | 4,596   |     |
| ウイン・パートナーズ          | 6.8     | 5.2   | 6,432   |     |
| シップヘルスケアホールディングス    | 31.5    | 36.4  | 80,225  |     |
| スターティアホールディングス      | —       | 1     | 2,181   |     |
| コメダホールディングス         | 21.6    | 22.8  | 65,504  |     |
| フルサト・マルカホールディングス    | 8.3     | 8.3   | 19,073  |     |
| ヤマエグループホールディングス     | 5       | 9.1   | 18,800  |     |
| 小野建                 | 8.7     | 8.7   | 12,928  |     |
| 南陽                  | 2.5     | 5     | 5,530   |     |
| 佐島電機                | 4.6     | 6.7   | 12,194  |     |
| エコートレーディング          | —       | 2.5   | 2,310   |     |
| 伯東                  | 5       | 5.2   | 22,594  |     |
| コンドーテック             | 7.6     | 7     | 9,653   |     |
| ナガイレーベン             | 11      | 12    | 25,500  |     |
| 三菱食品                | 8.3     | 9.3   | 44,547  |     |
| 松田産業                | 6.8     | 6.8   | 20,944  |     |
| 第一興商                | 33.8    | 35.3  | 65,481  |     |
| メディバルホールディングス       | 88.1    | 106.4 | 258,498 |     |
| SPK                 | 4.4     | 4.2   | 8,500   |     |
| 萩原電気ホールディングス        | 4.5     | 4.3   | 13,566  |     |
| アズワン                | 12.4    | 29.3  | 79,241  |     |
| スズデン                | 3.8     | 3.8   | 6,984   |     |
| 尾家産業                | 2.5     | 2.5   | 4,920   |     |
| シモジマ                | 6.7     | 6.6   | 8,481   |     |
| ドウシシャ               | 9       | 8.8   | 18,506  |     |
| 高速                  | 6       | 5.7   | 13,822  |     |
| たけがし                | 3.7     | 3.4   | 7,116   |     |
| リックス                | 2       | 2.5   | 6,900   |     |
| 丸文                  | 8.3     | 8.3   | 8,781   |     |
| ハビネット               | 7.9     | 9.4   | 39,856  |     |
| 日本ライフライン            | 25.7    | 25.9  | 34,058  |     |
| タカショー               | 9.6     | 11.9  | 5,355   |     |
| IDOM                | 26.8    | 40.3  | 45,136  |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄              | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|-----------------|---------|---------|-----------|-----|
|                 | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| 進和              | 5.8     | 5.8     | 16,309    |     |
| ダイترون          | 3.6     | 3.6     | 9,824     |     |
| シークス            | 12.3    | 12.5    | 14,162    |     |
| オーハシテクニカ        | 4.7     | 4.7     | 9,136     |     |
| 白銅              | 3.4     | 2.6     | 5,982     |     |
| 伊藤忠商事           | 584     | 635     | 4,763,770 |     |
| 丸紅              | 721.9   | 773.6   | 1,765,355 |     |
| 長瀬産業            | 39.5    | 41.7    | 128,561   |     |
| 蝶理              | 6       | 5.5     | 21,587    |     |
| 豊田通商            | 76.3    | 285.3   | 755,617   |     |
| 三共生興            | 14.6    | 14.8    | 8,968     |     |
| 兼松              | 33.7    | 37.8    | 95,426    |     |
| 三井物産            | 654.4   | 1,388.9 | 4,440,313 |     |
| 日本紙パルプ商事        | 4.6     | 46      | 29,946    |     |
| カメイ             | 9.5     | 9.5     | 17,499    |     |
| OUGホールディングス     | 1       | —       | —         |     |
| スターゼン           | 6.6     | 6.2     | 17,589    |     |
| 山善              | 22.4    | 39.2    | 51,195    |     |
| 椿本興業            | 2.5     | 6       | 11,508    |     |
| 住友商事            | 527.7   | 565.1   | 1,844,486 |     |
| 内田洋行            | 3.5     | 3.7     | 25,715    |     |
| 三菱商事            | 574     | 1,751   | 4,491,315 |     |
| 第一実業            | 9.3     | 9.2     | 22,356    |     |
| キャノンマーケティングジャパン | 20.2    | 19.2    | 92,985    |     |
| 西華産業            | 4       | 4       | 19,360    |     |
| 佐藤商事            | 6.3     | 6.2     | 8,574     |     |
| 菱洋エレクトロ         | 7.5     | —       | —         |     |
| 東京産業            | 8.9     | 8.9     | 6,408     |     |
| ユアサ商事           | 7.5     | 7.3     | 31,572    |     |
| 神鋼商事            | 2.3     | 2.3     | 13,800    |     |
| 阪和興業            | 15.5    | 16.1    | 77,924    |     |
| 正栄食品工業          | 5.8     | 6.1     | 26,047    |     |
| カナデン            | 6.7     | 6.9     | 9,867     |     |
| RYODEN          | 7.1     | 7.1     | 16,457    |     |
| 岩谷産業            | 19.9    | 96.6    | 179,965   |     |
| ナイス             | 2.6     | 2.6     | 4,006     |     |
| 極東貿易            | 5.9     | 5.4     | 8,532     |     |
| アステナホールディングス    | 18.3    | 18.3    | 8,893     |     |
| 三愛オブリ           | 22.9    | 22.2    | 42,424    |     |
| 稲畑産業            | 16.9    | 28.5    | 92,625    |     |
| G S Iクレオス       | 5.4     | 5       | 10,450    |     |
| 明和産業            | 12.5    | 12.5    | 7,912     |     |
| ワキタ             | 16.1    | 16.1    | 25,309    |     |
| 東邦ホールディングス      | 22.8    | 25.5    | 109,242   |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |      | 期末      |     |
|---------------------|---------|------|---------|-----|
|                     | 株数      | 株数   | 評価額     | 評価額 |
| サンゲツ                | 22      | 21.2 | 61,458  |     |
| ミツロコグループホールディングス    | 11.9    | 12.8 | 21,401  |     |
| シナネンホールディングス        | 3       | 2.9  | 18,531  |     |
| 伊藤忠エネクス             | 21.1    | 22.9 | 37,693  |     |
| サンリオ                | 24.8    | 76.4 | 383,375 |     |
| サンワ テクノス            | 4.6     | 4.6  | 10,106  |     |
| リョーサン               | 9.3     | —    | —       |     |
| 新光商事                | 12.3    | 13.5 | 13,500  |     |
| トーホー                | 4       | 4    | 11,168  |     |
| 三信電気                | 3.9     | 3.9  | 7,363   |     |
| 東陽テクニカ              | 9.2     | 9.1  | 13,104  |     |
| モスフードサービス           | 12.6    | 13.3 | 48,079  |     |
| 加賀電子                | 7       | 16   | 42,128  |     |
| ソーダニッカ              | 8       | 10.3 | 11,536  |     |
| 立花エレテック             | 6.4     | 6.4  | 16,800  |     |
| フォーバル               | —       | 1.7  | 2,305   |     |
| PALTA C             | 13.8    | 14.1 | 61,151  |     |
| 三谷産業                | 18.6    | 19   | 6,023   |     |
| 太平洋興発               | 6.4     | 3.4  | 2,424   |     |
| 西本Wismettacホールディングス | 2.3     | —    | —       |     |
| コア商事ホールディングス        | —       | 5.8  | 3,491   |     |
| KPPグループホールディングス     | 25      | 24.8 | 16,120  |     |
| ヤマタネ                | 4.5     | 4.5  | 16,582  |     |
| 泉州電業                | 4.8     | 6.5  | 33,540  |     |
| トラスコ中山              | 18.2    | 18.9 | 40,899  |     |
| オートボックスセブン          | 30.1    | 31.9 | 45,553  |     |
| モリト                 | 7.3     | 7.1  | 10,543  |     |
| 加藤産業                | 10.6    | 11.3 | 50,793  |     |
| イエローハット             | 15      | 15   | 38,265  |     |
| JKホールディングス          | 7.2     | 7.8  | 8,174   |     |
| 日伝                  | 6.5     | 6.4  | 19,584  |     |
| 杉本商事                | 5       | 8.6  | 11,601  |     |
| 因幡電機産業              | 21.9    | 28.9 | 111,380 |     |
| 東テク                 | 3       | 9.7  | 23,949  |     |
| ミスミグループ本社           | 131.5   | 142  | 348,255 |     |
| タキヒヨー               | 2.9     | 3.2  | 3,907   |     |
| スズケン                | 32.5    | 32   | 150,368 |     |
| ジェコス                | 6.1     | 6.1  | 5,990   |     |
| <b>小売業（4.6%）</b>    |         |      |         |     |
| ローソン                | 19.1    | —    | —       |     |
| サンエー                | 6.6     | 15.5 | 42,191  |     |
| カワチ薬品               | 7       | 7    | 17,773  |     |
| エービーシー・マート          | 37.8    | 41.6 | 129,667 |     |
| ハードオフコーポレーション       | 3.8     | 4.1  | 7,334   |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                        | 期首(前期末) |        | 期末      |     |
|---------------------------|---------|--------|---------|-----|
|                           | 株数      | 株数     | 評価額     | 評価額 |
| アスクル                      | 18.2    | 22.6   | 42,103  |     |
| ゲオホールディングス                | 9       | 10.4   | 16,848  |     |
| アダストリア                    | 10.6    | 12.9   | 47,278  |     |
| くら寿司                      | 10.3    | 10.9   | 42,292  |     |
| キャンドウ                     | 4.2     | 4.2    | 14,007  |     |
| バルグループホールディングス            | 17      | 21.6   | 70,200  |     |
| エディオン                     | 34.7    | 38.8   | 69,801  |     |
| サーラコーポレーション               | 18.9    | 20.1   | 16,140  |     |
| ハローズ                      | 4       | 4.2    | 16,989  |     |
| フジオフードグループ本社              | 10.6    | 11.5   | 13,880  |     |
| あみやき亭                     | 2.4     | 7.2    | 11,678  |     |
| 大黒天物産                     | 2.7     | 3      | 29,610  |     |
| ハニースホールディングス              | 7.2     | 8      | 13,200  |     |
| アルベン                      | 7.3     | 7.7    | 15,446  |     |
| クオールホールディングス              | 12.2    | 12.6   | 18,572  |     |
| ジンスホールディングス               | 5.3     | 7.4    | 44,474  |     |
| ビックカメラ                    | 46.2    | 57.3   | 95,347  |     |
| DCMホールディングス               | 50      | 49.2   | 69,372  |     |
| Monotaro                  | 123.7   | 134.5  | 359,182 |     |
| DDグループ                    | 1.5     | 2.9    | 3,770   |     |
| J. フロント リテイリング            | 104.2   | 108.4  | 195,445 |     |
| ドール・日レスホールディングス           | 15.4    | 15.6   | 35,474  |     |
| マツキヨココカラ&カンパニー            | 158.7   | 166.9  | 354,579 |     |
| ブロンコビリー                   | 5.2     | 5.4    | 20,790  |     |
| ZOZO                      | 57.7    | 70.6   | 334,644 |     |
| トレジャー・ファクトリー              | 4.2     | 6.8    | 8,724   |     |
| 物語コーポレーション                | 14.6    | 16.4   | 58,794  |     |
| 三越伊勢丹ホールディングス             | 147     | 143.4  | 310,819 |     |
| Hamee                     | —       | 4.9    | 5,252   |     |
| ウエルシアホールディングス             | 45.4    | 50     | 96,200  |     |
| クリエイトSDホールディングス           | 14.1    | 13.5   | 38,799  |     |
| チムニー                      | 3.5     | 2.2    | 2,730   |     |
| シュッピン                     | 7.2     | 8.5    | 8,568   |     |
| オイシックス・ラ・大地               | 11.8    | 15.3   | 23,194  |     |
| ネクステージ                    | 20      | 21.7   | 30,293  |     |
| ジョイフル本田                   | 25      | 25.7   | 46,157  |     |
| エターナルホスピタリティグループ          | 3.7     | 3.6    | 11,700  |     |
| ホットランド                    | 7.1     | 7.4    | 15,791  |     |
| すかいらーくホールディングス            | 119.2   | 130.2  | 300,111 |     |
| SFPホールディングス               | 4.6     | 4.6    | 8,818   |     |
| 綿半ホールディングス                | 7.1     | 7.3    | 11,110  |     |
| ヨシックスホールディングス             | —       | 2.3    | 7,291   |     |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 29.3    | 45.356 | 38,552  |     |

| 銘柄                          | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|-----------------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                             | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| BEENOS                      | 3.8     | 5.8     | 21,199    |     |
| あさひ                         | 7.6     | 7.5     | 11,857    |     |
| 日本調剤                        | 6.4     | 6.4     | 9,196     |     |
| コスモス薬品                      | 8.7     | 16.2    | 120,560   |     |
| セブン&アイ・ホールディングス             | 300.4   | 1,046.2 | 2,726,397 |     |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス       | 59.7    | 72.2    | 84,907    |     |
| ツルハホールディングス                 | 18.3    | 20      | 164,960   |     |
| サンマルクホールディングス               | 7.3     | 7       | 17,724    |     |
| フェリシモ                       | 4       | 4       | 3,352     |     |
| トリドールホールディングス               | 21.6    | 26.4    | 98,128    |     |
| TOKYO BASE                  | 10.4    | 11.6    | 3,317     |     |
| JMホールディングス                  | 6.9     | 6.9     | 18,588    |     |
| アレンザホールディングス                | 7.3     | 6.5     | 6,942     |     |
| 串カツ田中ホールディングス               | 3.8     | 0.8     | 1,144     |     |
| クスリのアオキホールディングス             | 23.4    | 32.1    | 110,263   |     |
| 力の源ホールディングス                 | 3.8     | 6.1     | 6,197     |     |
| FOOD & LIFE COMPANIES       | 46.6    | 50.5    | 173,568   |     |
| メディカルシステムネットワーク             | —       | 12      | 5,040     |     |
| ノジマ                         | 28.3    | 30.6    | 71,634    |     |
| カッパ・クリエイト                   | 13.7    | 15.6    | 24,570    |     |
| 良品計画                        | 95.4    | 112.8   | 351,823   |     |
| アドヴァングループ                   | 10.5    | 4.9     | 4,738     |     |
| アルビス                        | 3.1     | 2.6     | 6,765     |     |
| G-7ホールディングス                 | 9.6     | 10.6    | 15,253    |     |
| イオン北海道                      | 15.2    | 31.8    | 27,475    |     |
| コジマ                         | 15.6    | 18.7    | 20,364    |     |
| コーナン商事                      | 11.8    | 11.7    | 42,003    |     |
| エコス                         | 3.7     | 3.6     | 7,228     |     |
| ワタミ                         | 10.3    | 10.3    | 10,454    |     |
| 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 | 176.2   | 191.6   | 727,313   |     |
| 西松屋チェーン                     | 17.5    | 20.3    | 47,502    |     |
| ゼンショーホールディングス               | 43.2    | 53.8    | 489,526   |     |
| 幸楽苑                         | —       | 8.1     | 10,594    |     |
| サイゼリヤ                       | 13      | 13.9    | 72,836    |     |
| VTホールディングス                  | 34.5    | 33.1    | 15,689    |     |
| フジ・コーポレーション                 | 3.8     | 4.5     | 8,878     |     |
| ユナイテッドアローズ                  | 9.4     | 10.5    | 26,964    |     |
| ハイデイ日高                      | 13.1    | 14.6    | 40,894    |     |
| コロワイド                       | 39.7    | 54.4    | 91,908    |     |
| 壱番屋                         | 6.8     | 37.7    | 38,114    |     |
| スギホールディングス                  | 17.6    | 51.7    | 129,767   |     |
| 薬王堂ホールディングス                 | 4.6     | 4.8     | 9,854     |     |
| スクロール                       | 13.2    | 13.2    | 13,530    |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|------------------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                              | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| ヨンドシーホールディングス                | 7.7     | 8.1   | 14,936    |     |
| 木曾路                          | 12.8    | 13.6  | 27,975    |     |
| SRSホールディングス                  | 15.7    | 14.9  | 16,747    |     |
| リテールパートナーズ                   | 12.9    | 13    | 16,263    |     |
| 上新電機                         | 7.6     | 8.8   | 20,196    |     |
| 日本瓦斯                         | 46.5    | 47.1  | 96,955    |     |
| ロイヤルホールディングス                 | 16.5    | 16.5  | 40,177    |     |
| いなげや                         | 8.6     | —     | —         |     |
| チヨダ                          | 9.5     | 9.5   | 13,547    |     |
| ライフコーポレーション                  | 7.7     | 9.6   | 32,400    |     |
| リンガーハット                      | 11.1    | 12.1  | 26,728    |     |
| MrMaxHD                      | 13.2    | 10.7  | 7,318     |     |
| AOKIホールディングス                 | 16.9    | 19.3  | 24,009    |     |
| オークワ                         | 14.7    | 14.4  | 13,276    |     |
| コメリ                          | 13.4    | 14.1  | 45,402    |     |
| 青山商事                         | 18.9    | 19.9  | 45,073    |     |
| しまむら                         | 10.2    | 22.5  | 191,677   |     |
| 高島屋                          | 64.1    | 136   | 165,648   |     |
| 松屋                           | 15.3    | 16.3  | 14,295    |     |
| エイチ・ツー・オー リテイリング             | 41.6    | 48.6  | 101,744   |     |
| 近鉄百貨店                        | 4.8     | 4.9   | 9,937     |     |
| 丸井グループ                       | 60.4    | 63.3  | 154,641   |     |
| アクシアル リテイリング                 | 5.9     | 24.6  | 22,140    |     |
| イオン                          | 295.7   | 350.6 | 1,268,470 |     |
| イズミ                          | 13.2    | 15.8  | 49,564    |     |
| 平和堂                          | 14.8    | 14.9  | 34,061    |     |
| フジ                           | 13.2    | 18    | 36,684    |     |
| ヤオコー                         | 9.8     | 11.4  | 104,595   |     |
| ゼビオホールディングス                  | 12.2    | 12.6  | 14,074    |     |
| ケーズホールディングス                  | 61.5    | 66.5  | 93,931    |     |
| Olympicグループ                  | 5.2     | —     | —         |     |
| シルバライフ                       | 2.5     | —     | —         |     |
| Genky DrugStores             | 3.7     | 8.4   | 26,040    |     |
| ブックオフグループホールディングス            | 5.3     | 7.1   | 10,216    |     |
| ギフトホールディングス                  | 3.9     | 4.9   | 16,219    |     |
| アインホールディングス                  | 12.1    | 13.2  | 66,264    |     |
| GENKI GLOBAL DINING CONCEPTS | 6       | 5.8   | 21,460    |     |
| ヤマダホールディングス                  | 289.7   | 290   | 130,732   |     |
| アークランズ                       | 27.1    | 27.1  | 45,419    |     |
| ニトリホールディングス                  | 31.7    | 34.5  | 662,055   |     |
| グルメ軒屋                        | 8.3     | 7.6   | 8,086     |     |
| ケーユーホールディングス                 | 5.9     | 2.9   | 3,282     |     |
| 吉野家ホールディングス                  | 34      | 37.3  | 120,665   |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |         | 期末         |     |
|---------------------|---------|---------|------------|-----|
|                     | 株数      | 株数      | 評価額        | 評価額 |
| 松屋フーズホールディングス       | 4.1     | 4.6     | 29,762     |     |
| サガミホールディングス         | 13.8    | 13.8    | 23,998     |     |
| 関西フードマーケット          | 7.7     | —       | —          |     |
| 王将フードサービス           | 5.8     | 20.1    | 60,601     |     |
| ミニストップ              | 6.7     | 6.7     | 11,905     |     |
| アークス                | 16.1    | 16.8    | 42,537     |     |
| パローホールディングス         | 16.9    | 17      | 36,227     |     |
| ベルク                 | 4.3     | 4.7     | 31,490     |     |
| 大庄                  | 5       | 5.5     | 5,725      |     |
| ファーストリテイリング         | 39.2    | 53.2    | 2,682,876  |     |
| サンドラッグ              | 30.5    | 33      | 121,671    |     |
| サックスパー ホールディングス     | 7.7     | 8       | 7,344      |     |
| やまや                 | 2       | 1       | 2,829      |     |
| ペルーナ                | 21.2    | 21.2    | 15,942     |     |
| <b>銀行業（8.9%）</b>    |         |         |            |     |
| いざぎんホールディングス        | 97.1    | 113.6   | 180,851    |     |
| しずおかフィナンシャルグループ     | 180.8   | 193.5   | 264,514    |     |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ    | 68.3    | 74.3    | 125,827    |     |
| 楽天銀行                | 27.7    | 40.8    | 182,212    |     |
| 京都フィナンシャルグループ       | 25.7    | 110.9   | 262,722    |     |
| 島根銀行                | 4       | —       | —          |     |
| じもとホールディングス         | 7       | —       | —          |     |
| めぶきフィナンシャルグループ      | 403.7   | 439.5   | 294,728    |     |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ   | 10.5    | 10.9    | 47,905     |     |
| 九州フィナンシャルグループ       | 142.3   | 159     | 119,472    |     |
| ゆうちょ銀行              | 875     | 719.5   | 1,053,348  |     |
| 富山第一銀行              | 25      | 27.3    | 31,449     |     |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 436.2   | 468.1   | 436,222    |     |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | 50.6    | 52.9    | 108,286    |     |
| 三十三フィナンシャルグループ      | 7.5     | 7.5     | 15,697     |     |
| 第四北越フィナンシャルグループ     | 12.6    | 26.8    | 76,835     |     |
| ひろぎんホールディングス        | 105.7   | 119.9   | 139,443    |     |
| おきなわフィナンシャルグループ     | 6.9     | 6.9     | 17,070     |     |
| 十六フィナンシャルグループ       | 10.5    | 10.6    | 46,640     |     |
| 北國フィナンシャルホールディングス   | 8.5     | 8.9     | 47,170     |     |
| プロクレアホールディングス       | 10.1    | 10.8    | 19,407     |     |
| あいちフィナンシャルグループ      | 11.4    | 18.6    | 46,165     |     |
| あおぞら銀行              | 50.9    | 61.5    | 152,550    |     |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ   | 5,084.9 | 5,776.7 | 10,551,142 |     |
| りそなホールディングス         | 970.6   | 1,088.3 | 1,412,069  |     |
| 三井住友トラストグループ        | 145.8   | 313.6   | 1,191,680  |     |
| 三井住友フィナンシャルグループ     | 577     | 1,837   | 7,022,851  |     |
| 千葉銀行                | 226.4   | 272.6   | 352,199    |     |
| 群馬銀行                | 157.7   | 161.2   | 179,335    |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄              | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|-----------------|---------|---------|-----------|-----|
|                 | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| 武蔵野銀行           | 10.2    | 11      | 32,747    |     |
| 千葉興業銀行          | 13      | 20.6    | 29,437    |     |
| 筑波銀行            | 32      | 36.2    | 8,869     |     |
| 七十七銀行           | 26      | 27.7    | 125,342   |     |
| 秋田銀行            | 4.8     | 5.2     | 11,148    |     |
| 山形銀行            | 9       | 9.7     | 9,525     |     |
| 岩手銀行            | 5.8     | 5.8     | 15,596    |     |
| 東邦銀行            | 60      | 65.4    | 18,377    |     |
| 東北銀行            | 3       | 4.6     | 5,165     |     |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 64.8    | 75.7    | 322,936   |     |
| スルガ銀行           | 72.6    | 62.5    | 66,187    |     |
| 八十二銀行           | 170.8   | 205.1   | 214,124   |     |
| 山梨中央銀行          | 7.9     | 9.1     | 16,616    |     |
| 大垣共立銀行          | 15.4    | 15.4    | 29,275    |     |
| 福井銀行            | 7.5     | 7.5     | 14,122    |     |
| 清水銀行            | 3.6     | 3.6     | 5,400     |     |
| 富山銀行            | 1.5     | —       | —         |     |
| 滋賀銀行            | 13.6    | 14.4    | 56,088    |     |
| 南都銀行            | 12.3    | 12.4    | 39,432    |     |
| 百五銀行            | 76      | 80.5    | 50,554    |     |
| 紀陽銀行            | 28.9    | 31.4    | 66,316    |     |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 51.4    | 52      | 97,682    |     |
| 山陰合同銀行          | 50.5    | 54.1    | 68,003    |     |
| 鳥取銀行            | 2.5     | 3.9     | 4,804     |     |
| 百十四銀行           | 7.6     | 7.9     | 25,003    |     |
| 四国銀行            | 13.3    | 13.3    | 14,802    |     |
| 阿波銀行            | 11.5    | 12.1    | 34,908    |     |
| 大分銀行            | 5.1     | 5.1     | 16,065    |     |
| 宮崎銀行            | 5.2     | 5.2     | 15,990    |     |
| 佐賀銀行            | 5.1     | 5.1     | 10,924    |     |
| 琉球銀行            | 19.2    | 19.2    | 19,795    |     |
| セブン銀行           | 292.9   | 320.1   | 105,536   |     |
| みずほフィナンシャルグループ  | 1,105.3 | 1,189.2 | 4,612,906 |     |
| 高知銀行            | 2.5     | —       | —         |     |
| 山口フィナンシャルグループ   | 79      | 86.3    | 141,618   |     |
| 名古屋銀行           | 5.3     | 5.3     | 34,238    |     |
| 北洋銀行            | 123     | 131.3   | 61,185    |     |
| 大光銀行            | 2.5     | 2.3     | 3,282     |     |
| 愛媛銀行            | 11.6    | 11.6    | 12,203    |     |
| トマト銀行           | 2.5     | 5.1     | 5,788     |     |
| 京葉銀行            | 37.4    | 37.4    | 30,518    |     |
| 栃木銀行            | 39.2    | 42.1    | 11,872    |     |
| 北日本銀行           | 2.6     | 2.6     | 7,404     |     |
| 東和銀行            | 15.2    | 15.2    | 9,864     |     |

| 銘柄                            | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|-------------------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                               | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| 大東銀行                          | 3       | 8.5     | 6,018     |     |
| トモニホールディングス                   | 65.7    | 81.1    | 37,224    |     |
| フィデアホールディングス                  | 8.5     | 8.5     | 12,002    |     |
| 池田泉州ホールディングス                  | 100     | 114.3   | 46,177    |     |
| 証券・商品先物取引業（0.9%）              |         |         |           |     |
| F P G                         | 27.6    | 31.4    | 91,562    |     |
| ジャパンインベストメントアドバイザー            | 6.8     | 14.8    | 15,984    |     |
| マーキュリアホールディングス                | 5.7     | 2.7     | 2,416     |     |
| S B Iホールディングス                 | 117.4   | 141.1   | 551,418   |     |
| ジャフコ グループ                     | 27.5    | 26.5    | 56,087    |     |
| 大和証券グループ本社                    | 597.2   | 628     | 644,642   |     |
| 野村ホールディングス                    | 1,395.5 | 1,480.3 | 1,363,948 |     |
| 岡三証券グループ                      | 72.6    | 76.2    | 49,072    |     |
| 丸三証券                          | 28      | 29.1    | 28,605    |     |
| 東洋証券                          | 29.4    | 27.4    | 16,823    |     |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス          | 87      | 95.6    | 46,174    |     |
| 水戸証券                          | 23.8    | 25.2    | 13,935    |     |
| いちよし証券                        | 14.8    | 14.8    | 14,829    |     |
| 松井証券                          | 47.9    | 62      | 50,592    |     |
| マネックスグループ                     | 83.5    | 86.1    | 90,405    |     |
| 極東証券                          | 10.9    | 13.2    | 18,308    |     |
| 岩井コスモホールディングス                 | 9.4     | 9.4     | 21,385    |     |
| アイザワ証券グループ                    | 12.2    | 13.6    | 24,221    |     |
| スパークス・グループ                    | 9.2     | 9.6     | 13,929    |     |
| 保険業（3.4%）                     |         |         |           |     |
| かんぽ生命保険                       | 90.2    | 102.5   | 327,795   |     |
| F P パートナー                     | 1.3     | 4       | 9,420     |     |
| S O M P Oホールディングス             | 132.3   | 430.8   | 1,766,710 |     |
| アニコム ホールディングス                 | 28.5    | 30.3    | 20,543    |     |
| M S & A Dインシュアランスグループホールディングス | 176.7   | 645.5   | 2,219,229 |     |
| 第一生命ホールディングス                  | 396.7   | 414.5   | 1,784,422 |     |
| 東京海上ホールディングス                  | 802.4   | 857.9   | 4,897,751 |     |
| T & Dホールディングス                 | 226.7   | 236.6   | 686,613   |     |
| アドバンスクリエイト                    | 6.3     | —       | —         |     |
| その他金融業（1.2%）                  |         |         |           |     |
| 全国保証                          | 21.4    | 23.4    | 125,962   |     |
| あんしん保証                        | 1.7     | —       | —         |     |
| ジェイリース                        | 2.4     | 7.7     | 10,587    |     |
| イントラスト                        | —       | 3.9     | 3,108     |     |
| 日本モーゲージサービス                   | 7.5     | 10.1    | 4,322     |     |
| S B Iアルヒ                      | 11      | 11      | 9,042     |     |
| プレミアアグループ                     | 13.9    | 15.3    | 40,499    |     |
| ネットプロテクションズホールディングス           | 17.2    | —       | —         |     |



国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                | 期首(前期末) |       | 期末        |     |
|-------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                   | 株数      | 株数    | 評価額       | 評価額 |
| クレディセゾン           | 51.4    | 55.5  | 200,244   |     |
| 芙蓉総合リース           | 7.4     | 7.9   | 89,112    |     |
| みずほリース            | 11.9    | 74.9  | 75,274    |     |
| 東京センチュリー          | 15.1    | 66.4  | 101,027   |     |
| 日本証券金融            | 30.1    | 32.4  | 68,234    |     |
| アイフル              | 135.4   | 143.6 | 47,388    |     |
| リコーリース            | 7.6     | 8.3   | 42,994    |     |
| イオンフィナンシャルサービス    | 46.5    | 49.4  | 63,330    |     |
| アコム               | 148.5   | 185.3 | 71,340    |     |
| ジャックス             | 8.6     | 9.8   | 36,799    |     |
| オリエントコーポレーション     | 21.3    | 28.3  | 23,545    |     |
| オリックス             | 501.5   | 528.2 | 1,805,915 |     |
| 三菱HCキャピタル         | 334     | 439.4 | 448,188   |     |
| 九州リースサービス         | 5.6     | 4.8   | 5,016     |     |
| 日本取引所グループ         | 214.8   | 525.3 | 967,602   |     |
| イー・ギャランティ         | 13.7    | 15.1  | 25,292    |     |
| アサックス             | 5.4     | 2.9   | 2,070     |     |
| NECキャピタルソリューション   | 3.9     | 3.9   | 14,430    |     |
| <b>不動産業（1.8%）</b> |         |       |           |     |
| robot home        | 25.8    | 32    | 4,608     |     |
| 大東建託              | 29.7    | 30.2  | 509,776   |     |
| いちご               | 100.7   | 96.7  | 35,488    |     |
| 日本駐車場開発           | 94.3    | 109.2 | 24,460    |     |
| スター・マイカ・ホールディングス  | 11      | 11    | 7,414     |     |
| SREホールディングス       | 4.2     | 4     | 13,180    |     |
| ヒューリック            | 188.5   | 207.4 | 288,286   |     |
| 野村不動産ホールディングス     | 50.5    | 55    | 205,975   |     |
| 三重交通グループホールディングス  | 19.1    | 19.6  | 9,780     |     |
| サムディ              | 10.1    | —     | —         |     |
| ディア・ライフ           | 15      | 14.2  | 15,549    |     |
| 地主                | 7.1     | 7.4   | 15,762    |     |
| プレサンスコーポレーション     | 13.9    | 14.6  | 27,156    |     |
| JPMC              | 5.6     | 5.4   | 6,258     |     |
| フージャースホールディングス    | 13.4    | 12.2  | 12,346    |     |
| オープンハウスグループ       | 29.7    | 32.4  | 179,820   |     |
| 東急不動産ホールディングス     | 243.3   | 264.5 | 263,389   |     |
| 飯田グループホールディングス    | 77      | 85    | 191,930   |     |
| ムゲンエステート          | —       | 1.9   | 4,024     |     |
| And Doホールディングス    | —       | 4.1   | 4,050     |     |
| シーアールイー           | 5.3     | 5.3   | 6,450     |     |
| ケイアイスター不動産        | 4.2     | 4.6   | 19,481    |     |
| グッドコムアセット         | 8.9     | 8.9   | 7,840     |     |
| ジェイ・エス・ビー         | 4.4     | 4.4   | 12,095    |     |
| ロードスターキャピタル       | 5.9     | 5.9   | 14,761    |     |

| 銘柄                 | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|--------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                    | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| 霞ヶ関キャピタル           | —       | 3.9     | 48,204    |     |
| パーク24              | 53.5    | 69.8    | 125,291   |     |
| バラカ                | 3.9     | 3.2     | 5,692     |     |
| 宮越ホールディングス         | 4.6     | 4.6     | 8,606     |     |
| 三井不動産              | 368     | 1,223.1 | 1,548,444 |     |
| 三菱地所               | 517.9   | 510.7   | 1,079,364 |     |
| 平和不動産              | 13.9    | 14.3    | 60,989    |     |
| 東京建物               | 72.7    | 76.9    | 198,478   |     |
| 京阪神ビルディング          | 15.7    | 19.7    | 30,515    |     |
| 住友不動産              | 123.7   | 143.3   | 669,784   |     |
| テオオーシー             | 17.7    | 18.1    | 11,837    |     |
| 東京楽天地              | 1.8     | —       | —         |     |
| レオパレス21            | 92.5    | 88.1    | 50,128    |     |
| スターツコーポレーション       | 12.6    | 14.3    | 53,482    |     |
| フジ住宅               | 12.7    | 10.8    | 8,467     |     |
| 空港施設               | 12      | 12      | 6,948     |     |
| 明和地所               | —       | 6.2     | 6,280     |     |
| ゴールドクレスト           | 8.2     | 8.2     | 25,912    |     |
| エスリード              | 4.2     | 3.9     | 16,926    |     |
| 日神グループホールディングス     | 15.2    | 15.2    | 8,040     |     |
| 日本エスコン             | 19.6    | 22.6    | 22,102    |     |
| MIRARTHホールディングス    | 47.2    | 48.9    | 24,890    |     |
| イオンモール             | 41.9    | 54.9    | 111,447   |     |
| 毎日コムネット            | 6.3     | 6.3     | 4,460     |     |
| カチタス               | 22.4    | 24.2    | 51,497    |     |
| トーセイ               | 14.6    | 14.5    | 35,235    |     |
| 穴吹興産               | 2.9     | 2.7     | 5,383     |     |
| サンフロンティア不動産        | 15.5    | 13      | 24,141    |     |
| FJネクストホールディングス     | 9.6     | 8.8     | 10,067    |     |
| 日本空港ビルディング         | 28.8    | 31.7    | 161,638   |     |
| <b>サービス業（5.2%）</b> |         |         |           |     |
| LIFULL             | 32.4    | 36.5    | 6,935     |     |
| MIXI               | 19.1    | 19.5    | 54,463    |     |
| ジェイエイシーリクルートメント    | 7.5     | 32      | 22,144    |     |
| 日本M&Aセンターホールディングス  | 136.3   | 136.6   | 86,795    |     |
| メンバーズ              | 3.1     | 4.4     | 4,554     |     |
| UTグループ             | 12.3    | 11.9    | 24,192    |     |
| アイティメディア           | 3.5     | 3.6     | 5,418     |     |
| ケアネット              | —       | 18.1    | 10,660    |     |
| E・Jホールディングス        | 5.4     | 5.4     | 8,980     |     |
| オープンアップグループ        | 25.2    | 26.8    | 48,534    |     |
| コシダカホールディングス       | 25.6    | 27.7    | 31,384    |     |
| アルトナー              | 2       | 2       | 3,734     |     |
| パソナグループ            | 10.2    | 11      | 21,615    |     |

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                 | 期首(前期末) |       | 期末      |     |
|--------------------|---------|-------|---------|-----|
|                    | 株数      | 株数    | 評価額     | 評価額 |
| リンクアンドモチベーション      | 26.1    | 26.7  | 14,604  |     |
| エス・エム・エス           | 30.7    | 34.8  | 58,394  |     |
| パーソルホールディングス       | 884.4   | 856.3 | 199,004 |     |
| リニカル               | 6.3     | 5.5   | 1,892   |     |
| 学情                 | 4.5     | 4.7   | 8,276   |     |
| スタジオアリス            | 4.8     | 4.8   | 10,032  |     |
| N J S              | 1.5     | 2.1   | 7,738   |     |
| 総合警備保障             | 150.3   | 153.3 | 173,765 |     |
| カカクコム              | 57.6    | 66.1  | 165,216 |     |
| アイロムグループ           | 3.5     | —     | —       |     |
| セントケア・ホールディング      | 5.6     | 7.5   | 5,557   |     |
| ルネサンス              | 6.6     | 6.7   | 6,827   |     |
| ディップ               | 13.5    | 15.7  | 39,689  |     |
| デジタルホールディングス       | 5.5     | 6     | 7,452   |     |
| 新日本科学              | 7.7     | 9.1   | 14,714  |     |
| キャリアデザインセンター       | 1.4     | —     | —       |     |
| ベネフィット・ワン          | 31      | —     | —       |     |
| エムスリー              | 169     | 181.8 | 271,063 |     |
| アウトソーシング           | 54.4    | —     | —       |     |
| ウェルネット             | 5.5     | 4     | 3,456   |     |
| ワールドホールディングス       | 3.9     | 4.2   | 8,765   |     |
| ディー・エヌ・エー          | 33.8    | 36.5  | 88,968  |     |
| 博報堂DYホールディングス      | 107.8   | 105   | 119,962 |     |
| ぐるなび               | —       | 17.4  | 5,428   |     |
| タカミヤ               | 14      | 13.2  | 5,464   |     |
| ファンコミュニケーションズ      | 15      | 15    | 6,255   |     |
| ライク                | 3.8     | 3.8   | 5,247   |     |
| エスプール              | 25.6    | 30.2  | 9,513   |     |
| WDBホールディングス        | 4.5     | 4.5   | 7,578   |     |
| アドウェイズ             | 12.2    | 14.3  | 4,576   |     |
| バリューコマース           | 7.9     | 8.7   | 9,891   |     |
| インフォマート            | 88.1    | 94.6  | 26,393  |     |
| J Pホールディングス        | 27.1    | 26.2  | 16,427  |     |
| プレステージ・インターナショナル   | 42      | 43.3  | 29,140  |     |
| プロトコーポレーション        | 10.5    | 9.9   | 13,087  |     |
| アミューズ              | 5       | 5.3   | 7,261   |     |
| ドリームインキュベータ        | 2.8     | 3.2   | 10,048  |     |
| クイック               | 5.8     | 5.9   | 11,864  |     |
| 電通グループ             | 83.2    | 98.5  | 383,165 |     |
| テイクアンドギヴ・ニーズ       | —       | 4.5   | 4,153   |     |
| びあ                 | 3.1     | 3.4   | 10,540  |     |
| イオンファンタジー          | 3.5     | 4     | 12,200  |     |
| シーティーエス            | 10.6    | 10.6  | 9,391   |     |
| H. U. グループホールディングス | 24.8    | 25.9  | 63,416  |     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |         | 期末        |     |
|---------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                     | 株数      | 株数      | 評価額       | 評価額 |
| アルプス技研              | 7.8     | 8.2     | 21,033    |     |
| 日本空調サービス            | 10.2    | 10.2    | 10,261    |     |
| オリエンタルランド           | 449     | 549.3   | 1,915,958 |     |
| ダスキン                | 21      | 19.5    | 73,125    |     |
| 明光ネットワークジャパン        | 13.8    | 13.8    | 9,936     |     |
| ファルコホールディングス        | 4.3     | 4.9     | 11,025    |     |
| ラウンドワン              | 78      | 86      | 92,794    |     |
| リゾートトラスト            | 39      | 39      | 118,950   |     |
| ビー・エム・エル            | 10.2    | 11.5    | 32,579    |     |
| リソー教育               | 41.9    | 60.7    | 17,724    |     |
| 早稲田アカデミー            | 5.5     | 5.5     | 10,092    |     |
| ユー・エス・エス            | 97      | 190.2   | 264,948   |     |
| 東京個別指導学院            | 12.4    | 19      | 7,410     |     |
| サイバーエージェント          | 187.5   | 203.1   | 209,091   |     |
| 楽天グループ              | 725.6   | 648.9   | 549,748   |     |
| クリーク・アンド・リバー社       | 5.1     | 5.1     | 8,114     |     |
| SBIグローバルアセットマネジメント  | 15.8    | 18      | 12,096    |     |
| テー・オー・ダブリュ          | 19.3    | 23.8    | 7,425     |     |
| 山田コンサルティンググループ      | 3.1     | 4.3     | 8,733     |     |
| セントラルスポーツ           | 3.7     | 3.7     | 8,931     |     |
| フルキャストホールディングス      | 8       | 8.8     | 12,865    |     |
| エン・ジャパン             | 15.2    | 15.2    | 31,555    |     |
| テクノプロ・ホールディングス      | 50.1    | 53      | 147,790   |     |
| アイ・アールジャパンホールディングス  | 4.7     | 5.4     | 4,266     |     |
| KeepPer 技研          | 5       | 5.7     | 24,253    |     |
| Gunosy              | 8.1     | 9.2     | 6,430     |     |
| イー・ガーディアン           | 3.7     | 4.3     | 7,890     |     |
| ジャパンマテリアル           | 26      | 27.6    | 45,678    |     |
| ベクトル                | 11.7    | 11.7    | 11,407    |     |
| チャーム・ケア・コーポレーション    | 7.4     | 7.9     | 10,191    |     |
| キャリアリンク             | 3.2     | 3.6     | 8,859     |     |
| I B J               | 7.1     | 8.6     | 5,349     |     |
| アサンテ                | 5.2     | 5.2     | 8,533     |     |
| バリューHR              | 8       | 8       | 15,456    |     |
| M&Aキャピタルパートナーズ      | 6.9     | 7.7     | 20,235    |     |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 4.2     | 6.2     | 6,181     |     |
| ER Iホールディングス        | 1.9     | 1       | 2,135     |     |
| アビスト                | 0.5     | —       | —         |     |
| シグマックス・ホールディングス     | 11.3    | 24.6    | 22,632    |     |
| ウィルグループ             | 7       | 7       | 6,713     |     |
| メドピア                | 7.7     | 9.4     | 4,568     |     |
| リクルートホールディングス       | 628     | 717.6   | 7,620,912 |     |
| エラン                 | 11.5    | 12      | 8,112     |     |
| 日本郵政                | 999.8   | 1,031.8 | 1,594,131 |     |

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 銘柄                         | 期首(前期末) |      | 期末      |     |
|----------------------------|---------|------|---------|-----|
|                            | 株数      | 株数   | 評価額     | 評価額 |
| ベルシステム24ホールディングス           | 11.6    | 11.3 | 14,045  |     |
| 鎌倉新書                       | 7.4     | 9.9  | 5,296   |     |
| エアトリ                       | 6.5     | 7.2  | 7,812   |     |
| アトラエ                       | 5.9     | 7.8  | 6,864   |     |
| ストライク                      | 3.8     | 4.3  | 16,598  |     |
| ソラスト                       | 23.7    | 25.4 | 11,836  |     |
| セラク                        | 2.9     | 2.5  | 3,292   |     |
| インソース                      | 18.5    | 20.1 | 21,567  |     |
| ペイカレント                     | 62.2    | 67.5 | 380,227 |     |
| Orchestra Holdings         | —       | 2.5  | 2,032   |     |
| アイモバイル                     | 14.1    | 14.1 | 7,585   |     |
| MS-Japan                   | —       | 4    | 4,216   |     |
| ジャパンエレベーターサー<br>ビスホールディングス | 27.3    | 35.6 | 98,612  |     |
| グリーンズ                      | 2.4     | 1.2  | 2,173   |     |
| ウェルビー                      | 5.4     | —    | —       |     |
| エル・ティエ・エス                  | 1.3     | 1.3  | 3,112   |     |
| ミダックホールディングス               | 5.3     | 5.7  | 9,536   |     |
| キュービネットホールディングス            | 4.7     | 5.9  | 6,006   |     |
| オープングループ                   | 13.4    | 16.6 | 3,270   |     |
| マネジメントソリューションズ             | 3.8     | 4.3  | 7,520   |     |
| フロンティア・マネジメント              | 2.3     | 2.6  | 2,046   |     |
| コプロ・ホールディングス               | —       | 1.6  | 2,849   |     |
| アンビスホールディングス               | 8.6     | 19.4 | 17,130  |     |
| カープスホールディングス               | 23.2    | 24.4 | 19,837  |     |
| フォーラムエンジニアリング              | 10.2    | 13   | 12,701  |     |
| FAST FITNESS JAPAN         | 3.4     | 3.8  | 5,339   |     |
| ダイレクトマーケティングミックス           | 10.9    | 13.8 | 3,615   |     |
| ポピンズ                       | —       | 1.6  | 2,048   |     |
| LITALICO                   | 6.7     | 8    | 7,552   |     |
| リログループ                     | 45.7    | 51.3 | 94,622  |     |
| 東祥                         | 6.9     | 6    | 3,762   |     |
| ID&E ホールディングス              | 5.1     | —    | —       |     |
| ビーウィズ                      | 2.4     | 2.4  | 3,604   |     |
| TR Eホールディングス               | 17.9    | 19.9 | 32,536  |     |
| 人・夢・技術グループ                 | 3.6     | 3.6  | 5,382   |     |
| NISSOホールディングス              | 6.8     | 9    | 6,894   |     |
| 大栄環境                       | 15.5    | 19.9 | 61,292  |     |
| 日本管財ホールディングス               | 8.4     | 8.9  | 22,855  |     |
| M&A総研ホールディングス              | 4       | 9.7  | 19,729  |     |
| エイチ・アイ・エス                  | 24.7    | 29.2 | 52,268  |     |
| ラックランド                     | 4.1     | —    | —       |     |
| 共立メンテナンス                   | 14.3    | 28.6 | 78,564  |     |

| 銘柄                | 期首(前期末) |           | 期末          |             |
|-------------------|---------|-----------|-------------|-------------|
|                   | 株数      | 株数        | 評価額         | 評価額         |
| イチネンホールディングス      | 9.1     | 9.1       | 17,080      |             |
| 建設技術研究所           | 4.4     | 4.6       | 22,333      |             |
| スペース              | 7.1     | 7.1       | 8,115       |             |
| 燦ホールディングス         | 7.6     | 8.5       | 8,814       |             |
| スバル興業             | 0.5     | 3.2       | 9,392       |             |
| 東京テアトル            | 5       | 7         | 7,602       |             |
| タナベコンサルティン グループ   | 1.5     | —         | —           |             |
| ナガワ               | 2.9     | 2.9       | 17,748      |             |
| 東京都競馬             | 7.2     | 7.6       | 32,566      |             |
| カナモト              | 14.4    | 14.4      | 42,076      |             |
| ニシオホールディングス       | 7.6     | 8.3       | 30,876      |             |
| トランス・コスモス         | 10.4    | 11.3      | 38,815      |             |
| 乃村工藝社             | 36.6    | 40.1      | 31,077      |             |
| 藤田観光              | 3.8     | 4         | 35,720      |             |
| KNT-CTホールディングス    | 2       | 6.1       | 7,320       |             |
| トーカイ              | 7.5     | 7.6       | 16,644      |             |
| セコム               | 86.2    | 188.6     | 991,281     |             |
| セントラル警備保障         | 4.7     | 5         | 13,435      |             |
| 丹青社               | 17      | 18.2      | 14,705      |             |
| メイテックグループホールディングス | 32.5    | 33.2      | 93,740      |             |
| 応用地質              | 7.8     | 8.7       | 20,967      |             |
| 船井総研ホールディングス      | 17.6    | 18.5      | 44,418      |             |
| いであ               | 2.5     | 0.7       | 1,748       |             |
| 学究社               | 4.2     | 4.2       | 8,047       |             |
| イオンディライト          | 9.2     | 9.8       | 44,051      |             |
| ダイセキ              | 17.3    | 21.8      | 86,001      |             |
| ステップ              | 3.2     | 3.2       | 6,486       |             |
| 合計                | 株数・金額   | 123,739.3 | 167,786.556 | 347,546.634 |
|                   | 銘柄数<比率> | 1,733銘柄   | 1,710銘柄     | <97.9%>     |

※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<br>7,453 | 百万円<br>— |
| T O P I X |              |          |

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

### ■ 投資信託財産の構成

（2024年12月2日現在）

| 項 目                     | 期 末               |       |
|-------------------------|-------------------|-------|
|                         | 評 価 額             | 比 率   |
| 株 式                     | 千円<br>347,546,634 | %     |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 7,495,005         | 2.1   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 355,041,639       | 100.0 |

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2024年12月2日現在）

| 項 目                         | 期 末              |
|-----------------------------|------------------|
| (A) 資 産                     | 355,033,097,891円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等             | 5,108,445,599    |
| 株 式 (評価額)                   | 347,546,634,260  |
| 未 収 入 金                     | 36,327,500       |
| 未 収 配 当 金                   | 1,894,343,199    |
| 差 入 委 託 証 拠 金               | 447,347,333      |
| (B) 負 債                     | 37,295,941       |
| 未 払 解 約 金                   | 37,295,941       |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B)       | 354,995,801,950  |
| 元 本                         | 72,554,135,505   |
| 次 期 繰 越 損 益 金               | 282,441,666,445  |
| (D) 受 益 権 総 口 数             | 72,554,135,505口  |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 48,928円          |

※当期における期首元本額67,612,101,406円、期中追加設定元本額12,660,331,796円、期中一部解約元本額7,718,297,697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12月1日 至2024年12月2日）

| 項 目                           | 当 期              |
|-------------------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益                 | 7,770,358,895円   |
| 受 取 配 当 金                     | 7,743,924,920    |
| 受 取 利 息                       | 4,765,558        |
| そ の 他 収 益 金                   | 21,882,805       |
| 支 払 利 息                       | △ 214,388        |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益           | 40,535,848,996   |
| 売 買 益                         | 55,280,108,623   |
| 売 買 損                         | △ 14,744,259,627 |
| (C) 先 物 取 引 等 損 益             | 923,379,300      |
| 取 引 益                         | 1,403,632,500    |
| 取 引 損                         | △ 480,253,200    |
| (D) そ の 他 費 用 等               | △ 1,311,402      |
| (E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D) | 49,228,275,789   |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金             | 215,026,856,677  |
| (G) 解 約 差 損 益 金               | △ 28,555,541,526 |
| (H) 追 加 信 託 差 損 益 金           | 46,742,075,505   |
| (I) 合 計 (E + F + G + H)       | 282,441,666,445  |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (I)             | 282,441,666,445  |

※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          | 9,702,422,057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）                      | 124,122,082円   |
| 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）         | 957,036,690円    | 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）                        | 121,945,870円   |
| 三井住友・DC年金バランス50（標準型）           | 4,251,248,630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）                      | 46,832,851円    |
| 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）         | 3,707,905,585円  | SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）                       | 2,099,092,431円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）   | 127,881,626円    | バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞                        | 6,851,130円     |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2020（4資産タイプ） | 3,013,492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＞                     | 33,548,131円    |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2025（4資産タイプ） | 11,510,786円     | SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞                        | 628,141,455円   |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2030（4資産タイプ） | 36,619,513円     | SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞                      | 970,735,898円   |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2035（4資産タイプ） | 120,953,877円    | SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞                        | 3,825,404,678円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2040（4資産タイプ） | 122,493,463円    | SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞                        | 23,860,855円    |
| 三井住友・DCターゲットイヤーフンド2045（4資産タイプ） | 244,601,733円    | SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞                        | 91,834,407円    |
| 国内株式指数ファンド（TOPIX）              | 1,564,038,268円  | SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞                        | 553,619,781円   |
| 三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド  | 30,022,152,231円 | SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞                     | 29,035,936円    |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型）          | 174,427,540円    | SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞                     | 156,249,124円   |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）        | 265,456,111円    | SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞                     | 550,944,603円   |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型）          | 162,450,294円    | SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞                        | 341,910,147円   |
| イオン・バランス戦略ファンド                 | 24,733,599円     | SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞                        | 1,011,842,625円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2050       | 92,567,676円     | SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞                       | 21,800,000円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）         | 223,403,836円    | SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞                   | 21,589,749円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）         | 226,296,448円    | SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞                   | 16,103,674円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）         | 942,329,191円    | SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞                   | 13,315,109円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）         | 575,251,307円    | SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞                   | 49,496,968円    |
| 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）         | 727,911,332円    | SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞                   | 137,001,789円   |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド       | 75,438,330円     | SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞                  | 28,518,468円    |
| 三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド        | 1,617,967,576円  | SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞                  | 28,327,919円    |
| 三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）         | 43,777,871円     | SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞                  | 6,486,356円     |
| 三井住友DS・年金バランス50（標準型）           | 263,218,822円    | SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞                  | 24,002,389円    |
| 三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）         | 302,123,418円    | SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞                  | 323,102,421円   |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2060       | 20,362,423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）                   | 151,278,192円   |
| 日興FWS・日本株インデックス                | 3,196,332,952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＞                | 131,051,025円   |
| 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド        | 255,353,062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＞              | 53,003,126円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2035       | 53,546,400円     | SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞                        | 37,593,666円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2040       | 34,155,161円     | SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞                       | 23,747,703円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2045       | 31,355,200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＞                    | 25,219,091円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2055       | 20,495,407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＞            | 17,887,238円    |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2065       | 17,698,318円     | SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞                  | 27,590,725円    |
| 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）   | 875,783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＞ | 498,169,697円   |
| 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）   | 24,752,883円     | SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド（リスク3%）＜適格機関投資家限定＞            | 58,718,705円    |

## ■ 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いましたが、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ファンドの基準価額への影響は+3円程度となります。