

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/資産複合/インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2017年10月3日）		
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資を行い、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。		
主要投資対象	マザーファンド	対象指数	基本資産 配分比率
	国内債券パッシブ・マザーファンド	NOMURA-BPI（総合）	15%
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）	5%
	外国債券パッシブ・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）	20%
	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	TOPIX（東証株価指数、配当込み）	10%
	外国株式インデックス・マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）	20%
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）	10%
	リート・インデックス・マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）	5%
	外国リート・インデックス・マザーファンド	S&P先達国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）	15%
	当ファンドの運用方法	<ul style="list-style-type: none"> <li>■マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。</li> <li>■各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせた合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。</li> <li>■実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対価の為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として為替ヘッジは行いません。</li> </ul>	
組入制限	当ファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>■株式への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</li> <li>■外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</li> <li>■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</li> <li>■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>	
	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	<ul style="list-style-type: none"> <li>■株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>■外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>	
	外国株式インデックス・マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>■株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>■株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>	
	リート・インデックス・マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>■株式への投資は行いません。</li> <li>■外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>■株式への投資は行いません。</li> <li>■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>	
	年一回（原則として毎年9月10日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。		
	分配対象額は、経費控除後の剰子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。		
	分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。		
	※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。		
	ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向によっては変更する場合があります。）		

# 三井住友・ DCつみたてNISA・ 世界分散ファンド

## 【運用報告書(全体版)】

(2022年9月13日から2023年9月11日まで)

# 第6期

決算日 2023年9月11日

### 受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

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

## 三井住友DSアセットマネジメント

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

### ■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

### ■当運用報告書についてのお問い合わせ

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

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

## ■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) 合成指数		株式組入比率	株式先物比率 (買建-売建)	公社債組入比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率					
2期 (2019年9月10日)	円 10,442	円 0	% 3.9	106.37	% 4.5	% 33.6	% 5.5	% 38.8	% 20.7	百万円 295
3期 (2020年9月10日)	10,720	0	2.7	110.12	3.5	34.8	3.6	39.3	20.9	544
4期 (2021年9月10日)	12,869	0	20.0	133.41	21.1	35.9	2.5	39.1	21.2	1,014
5期 (2022年9月12日)	13,461	0	4.6	140.38	5.2	36.8	1.4	39.0	21.5	1,634
6期 (2023年9月11日)	14,055	0	4.4	147.68	5.2	37.6	0.8	38.8	20.8	2,217

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※ベンチマークは、NOMURA-BPI (総合) 15%、FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ換算ベース) 5%、FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) 20%、TOPIX (東証株価指数、配当込み) 10%、MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース) 20%、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース) 10%、東証REIT指数 (配当込み) 5%およびS&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース) 15%の割合で組み合わせた合成指数で、当報告書作成時に知りえた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、外国の指数については基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) 合成指数		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	公 社 債 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 率 比
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %				
(期 首) 2022年 9月12日	13,461	—	140.38	—	36.8	1.4	39.0	21.5
9 月 末	12,584	△6.5	131.05	△6.6	35.4	1.9	40.8	20.2
10 月 末	13,115	△2.6	136.76	△2.6	35.7	2.4	38.6	21.8
11 月 末	13,016	△3.3	135.89	△3.2	35.3	3.2	38.7	21.0
12 月 末	12,438	△7.6	129.93	△7.4	36.1	1.7	39.6	20.7
2023年 1 月 末	12,803	△4.9	133.94	△4.6	36.0	2.4	38.6	21.3
2 月 末	12,934	△3.9	135.31	△3.6	35.9	2.3	39.4	21.0
3 月 末	12,865	△4.4	134.65	△4.1	36.8	1.5	39.9	20.2
4 月 末	13,052	△3.0	136.72	△2.6	36.3	1.7	39.1	21.2
5 月 末	13,365	△0.7	140.12	△0.2	36.6	1.6	39.1	21.2
6 月 末	13,995	4.0	146.89	4.6	36.7	1.7	38.9	21.1
7 月 末	14,027	4.2	147.25	4.9	37.3	1.7	38.2	20.8
8 月 末	14,151	5.1	148.69	5.9	36.5	2.0	38.9	20.7
(期 末) 2023年 9月11日	14,055	4.4	147.68	5.2	37.6	0.8	38.8	20.8

※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(2022年9月13日から2023年9月11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	13,461円
期末 (既払分配金0円(税引前))	14,055円
騰落率 (分配金再投資ベース)	+4.4%

## 分配金再投資基準価額について

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

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

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI(総合)15%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)5%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)20%、TOPIX(東証株価指数、配当込み)10%、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)20%、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)10%、東証REIT指数(配当込み)5%およびS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)15%の割合で組み合わせた合成指数です。

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

### 基準価額の主な変動要因(2022年9月13日から2023年9月11日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資し、各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせた合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指しました。実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、為替ヘッジは行いませんでした。

#### 上昇要因

- 国内を含む先進国株式市場が上昇したこと
- 米ドルやユーロ等、主要通貨に対して円安が進行したこと

#### 下落要因

- 国内外の金利が上昇(債券価格は下落)したこと
- 国内外のリート市場が下落したこと

## 投資環境について(2022年9月13日から2023年9月11日まで)

期を通して見ると、国内株式市場、先進国外国株式市場は上昇となった一方、新興国株式市場は概ね横ばいとなりました。債券市場では、国内外で金利が上昇しました。また、リート市場は、国内外で下落しました。外国為替市場では、米ドル、ユーロ等の主要通貨に加え、新興国通貨も円に対して概ね上昇しました。

## 株式市場

### ●先進国外国株式

期を通じて、先進国外国株式市場は上昇しました。

期初から10月にかけては、インフレ加速に伴う欧米中央銀行の一段の利上げが景気後退を招くとの懸念から下落しました。その後は、米国のインフレ鈍化の兆候による利上げペース減速への期待や概ね良好な企業業績を材料に持ち直しました。

2023年3月にかけて欧米の金融不安によるリスク回避の動きが強まり下落する局面もありましたが、その後は米国の堅調な経済指標や利上げ打ち止め観測等が支援材料となり、期末にかけて上昇基調となりました。

### ●国内株式

期を通じて、国内株式市場は上昇しました。

期初から年末にかけては、株価はボックス圏で推移しました。年明け以降、米国の

利上げペース減速への期待等から上昇基調となりました。4月以降は、日銀の金融緩和方針維持による円安進展や海外投資家による日本株買いが好感され、上値を切り上げて推移しました。

7月の金融政策決定会合にてイールドカーブ・コントロール(長短金利操作)の運用柔軟化の決定を無難に消化すると、期末にかけて円安が一段と進行する中、好業績銘柄がけん引する形で上昇しました。

### ●新興国株式

期を通じて、新興国株式市場は概ね横ばいとなりました。

期初から10月にかけては、インフレ加速を受けた欧米の金融引き締めを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり下落しました。その後は欧米の底堅い経済指標やインフレ減速の兆しが見え始めたことで、反発しました。

年明け以降は、米中関係の悪化懸念等から下落する局面もありましたが、底堅い経済指標やインフレのピークアウト観測が支

援材料となり、ボックス圏で推移しました。

## 債券市場

### ●先進国外国債券

米国や欧州の長期金利(10年国債利回り)は、期を通じて上昇しました。

インフレ懸念が継続し、主要国の中央銀行による金融引き締めが継続される中、欧米金利は上昇しました。3月に欧米で金融不安が高まった局面では一時的に金利低下も見られましたが、懸念が和らぎ再びインフレ圧力の根強さや景気の底堅さに注目が戻る中で、期末にかけて金利は上昇しました。

### ●国内債券

日本の長期金利は、期を通じて上昇しました。

日銀の金融緩和政策修正への思惑とともに、金利が上下する展開となりました。12月の金融政策決定会合にて長期金利の許容変動幅の拡大が発表されると、金利は上昇しました。

3月に欧米で金融不安が高まった局面では大幅に金利低下する局面もありましたが、7月の金融政策決定会合にてイールドカーブ・コントロールの運用柔軟化が発表されると、金利は再度上昇しました。

## リート市場

### ●グローバルリート

グローバルリート市場は、期を通じて下落しました。

期初から10月にかけては、世界的なインフレの高止まりや欧米中央銀行による積極的な金融引き締めが意識される中、欧米の長期金利が大きく上昇したことが嫌気され、下落しました。

その後、FRB(米連邦準備制度理事会)が利上げペースを減速するとの期待から上昇に転じましたが、3月にかけては、欧米の金融不安によるリスク回避の動きを受けて再び下落しました。

期末にかけては、FRBの利上げ停止観測の高まりや後退を受けて一進一退の展開となり、期を通して見ると下落しました。

### ●国内リート

国内リート市場は、期を通じて下落しました。

期初から10月にかけては、世界的なインフレと海外の金融当局による連続的な利上げを受けて、国内リート市場は下落しました。12月の日銀金融政策決定会合で長期金利の変動許容幅が拡大されると、一段と国内リート市場は低調な推移となりました。

3月の欧米発の金融不安が波及し、一段と弱含む展開となりました。その後、各国金融当局の迅速な対応により、国内リート

市場は持ち直す動きとなりましたが、期を通して見ると下落しました。

---

## 為替市場

### ●米ドル・円

米ドル・円は、期を通じて、米ドル高・円安となりました。

F R Bが利上げペースを減速するとの見方から、期中に米ドル安・円高が進行する場面もありましたが、米景気が底堅く推移する中、F R Bがタカ派(インフレ抑制を重視する立場)姿勢を維持した一方、日銀は緩和姿勢を維持したことから、金融政策の方向性の違いを背景に、期を通して見ると米ドル高・円安が進行しました。

### ●ユーロ・円

ユーロ・円は、期を通じて、ユーロ高・円安となりました。

ユーロ圏ではインフレが高止まりする中、E C B (欧州中央銀行) が利上げを継続した一方、日銀は緩和姿勢を維持したことから、金融政策の方向性の違いを背景に、ユーロ高・円安が進行しました。

### ●新興国通貨

新興国通貨は一部通貨を除き、概ね円に対して上昇しました。

日銀が緩和姿勢を維持し円が下落したことで、メキシコペソをはじめとする多くの

新興国通貨が円に対し上昇しました。ただし、トルコリラ等の一部通貨は、政局・金融政策に対する不透明感等を背景に円に対し下落しました。



## ポートフォリオについて(2022年9月13日から2023年9月11日まで)

## 当ファンド

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

マザーファンドへの投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとしました。

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

投資対象マザーファンド	投資対象資産	基本資産配分
国内債券パッシブ・マザーファンド	国内債券	15%
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	先進国債券 (除く日本、 為替ヘッジあり)	5%
外国債券パッシブ・マザーファンド	先進国債券 (除く日本)	20%
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	国内株式	10%
外国株式インデックス・マザーファンド	先進国株式 (除く日本)	20%
エマージング株式インデックス・マザーファンド	新興国株式	10%
Jリート・インデックス・マザーファンド	国内リート	5%
外国リート・インデックス・マザーファンド	外国リート	15%

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI(総合)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、デュレーション(投資資金の平均回収期間:金利の変動による債券価格の感応度)、満期・債券種別・格付け構成等をベンチマークに合わせつつ、個別銘柄については分散投資を図りました。また、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値(デュレーション等)をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランス(投資配分比率の調整)を行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。具体的には、ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラー(ポートフォリオとベンチマークのリターン乖離)を最小化するよう努めました。

ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行いました。

保有する外貨建資産については、為替の

フルヘッジを原則としました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

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

具体的には、通貨・国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りベンチマークに近似させるよう調整しました。

インデックス構成銘柄の変更が実施される毎月末において、ファンドの特性値(国別比率、デュレーション等)をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランスを行いました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数、配当込み)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、TOPIXに採用されている銘柄のうち流動性や信用リスクを考慮して投資し、また、連動性を高めつつ、ファンドの資金流入に機動的に対応するため、株式先物の売買を行いました。

月次ベースの推定トラッキングエラーが拡大する場合には、現物株式のリバランス

を実施しトラッキングエラーを低く抑えめました。組入比率は期を通じて高位を保ちました。

---

### 外国株式インデックス・マザーファンド

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

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

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

---

### エマーシング株式インデックス・マザーファンド

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

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

日々の追加設定・解約による資金変動には株式指数先物取引を利用し、実質株式組

入比率の調整を行い、トラッキングエラーを低く抑えめました。

また2、5、8、11月末のMSCIEマーキング・マーケット・インデックスの定期銘柄見直しに応じて、ポートフォリオの修正を行いました。

---

### Jリート・インデックス・マザーファンド

ベンチマークである東証REIT指数(配当込み)に連動する投資成果を目指した運用を行いました。

具体的には、原則として指数採用銘柄への時価構成比に応じた投資を行いました。

組入比率は期を通じて高位を保ちました。

---

### 外国リート・インデックス・マザーファンド

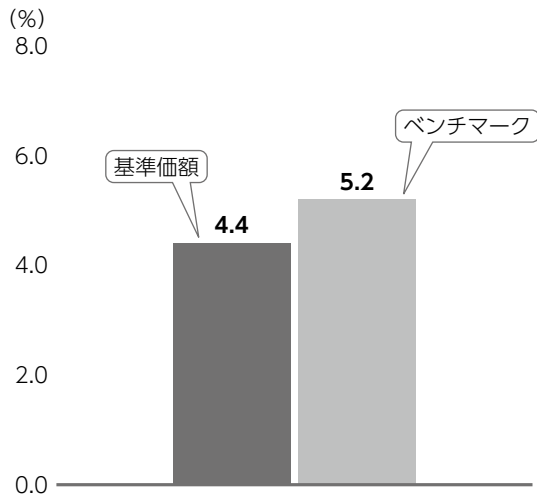
S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

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

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

## ベンチマークとの差異について(2022年9月13日から2023年9月11日まで)

## 基準価額とベンチマークの騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせた合成指数をベンチマークとしております。記載のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

## ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は+4.4%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+5.2%を0.8%下回りました。

## 下方乖離要因

- 信託報酬等の費用がかかったこと

## 分配金について(2022年9月13日から2023年9月11日まで)

(単位:円、1万口当たり、税引前)

項目	第6期
当期分配金	0
(対基準価額比率)	(0.00%)
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	4,055

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

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

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

## 2 今後の運用方針

### 当ファンド

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

マザーファンドへの投資を通じて行う各資産への投資は基本資産配分に基づき実施します。

実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対円での為替ヘッジを行って

る場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行わない方針です。

---

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、NOMURA-BPI(総合)に連動する投資成果を目指して運用を行います。デュレーション、満期構成、流動性等を考慮して選択した債券に分散投資し、債券組入比率を高位に保つことを基本とします。

---

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

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

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

通貨に関してはフルヘッジを継続します。

債券組入比率は高位に保つことを基本とします。

---

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

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

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

また月次のベンチマーク更新時や、日々の資金流出入に対応し、迅速なリバランス

を行います。

債券組入比率は高位に保つことを基本とします。

---

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

引き続き、TOPIX(東証株価指数、配当込み)に連動する投資成果を目指して運用を行います。

流動性や信用リスクに懸念のある銘柄を除き、個別銘柄においてもTOPIX時価ウェイトに沿った投資を行い、トラッキングエラーを抑制します。また、先物を含めた実質株式組入比率を高位に保つことを基本とします。

---

## 外国株式インデックス・マザーファンド

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

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

### エマージング株式インデックス・マザーファンド

引き続き、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。また、株式組入比率(投資信託証券、先物含む)を概ね100%程度に保つことを基本とします。

### Jリート・インデックス・マザーファンド

引き続き、東証REIT指数(配当込み)に連動する投資成果を目指して運用を行います。

採用銘柄への時価構成比に応じた投資を行うことにより、ベンチマークとの連動を目指した運用を行います。組入比率は高位に保つことを基本とします。

### 外国リート・インデックス・マザーファンド

引き続き、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。個別銘柄においてもベンチマーク時価ウェイトに沿った投資を行い、トラッキングエラーを抑制します。また、リート組入比率を高位に保つことを基本とします。

## 3 お知らせ

### 約款変更等のお知らせ

該当事項はございません。

## 1万口当たりの費用明細(2022年9月13日から2023年9月11日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
<b>(a) 信託報酬</b>	<b>30円</b>	<b>0.230%</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> 期中の平均基準価額は13,183円です。
(投信会社)	(13)	(0.099)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(14)	(0.110)	販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
<b>(b) 売買委託手数料</b>	<b>3</b>	<b>0.019</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> 売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(1)	(0.010)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(1)	(0.007)	
<b>(c) 有価証券取引税</b>	<b>1</b>	<b>0.005</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> 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.004)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
<b>(d) その他費用</b>	<b>5</b>	<b>0.039</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)	(4)	(0.030)	保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.007)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.002)	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>39</b>	<b>0.294</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。

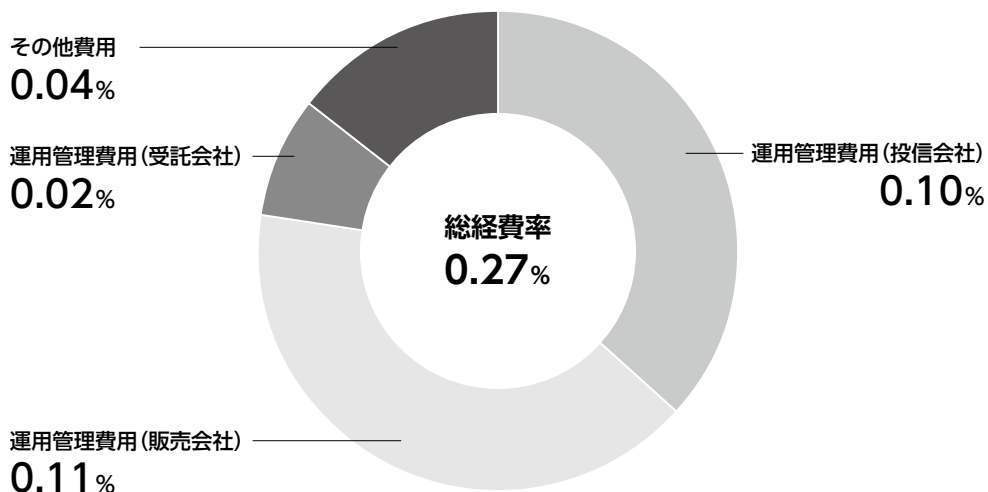
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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0.27%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2022年9月13日から2023年9月11日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	10,266	36,385	3,977	14,890
外国株式インデックス・マザーファンド	13,107	81,201	3,946	26,405
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	27,418	34,485	73	91
外国債券パッシブ・マザーファンド	54,490	108,702	4,280	8,649
国内債券パッシブ・マザーファンド	82,656	101,900	6,014	7,440
Jリート・インデックス・マザーファンド	11,115	28,763	35	91
外国リート・インデックス・マザーファンド	34,565	94,259	2,124	6,060
エマージング株式インデックス・マザーファンド	30,203	50,145	4,132	7,030

■ 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

(2022年9月13日から2023年9月11日まで)

項 目	当 期		
	国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	外国株式インデックス・マザーファンド	エマージング株式インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	42,894,502千円	96,957,722千円	10,063,748千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	232,691,804千円	458,842,152千円	22,603,846千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.18	0.21	0.44

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2022年9月13日から2023年9月11日まで)

### (1) 利害関係人との取引状況

#### 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公 社 債	百万円 56,187	百万円 3,105	% 5.5	百万円 53,664	百万円 6,330	% 11.8

※平均保有割合 0.2%

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

#### 国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株 式	百万円 30,659	百万円 9,992	% 32.6	百万円 12,234	百万円 2,481	% 20.3
株 式 先 物 取 引	49,150	696	1.4	51,025	2,349	4.6

※平均保有割合 0.1%

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

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投 資 信 託 証 券	百万円 6,685	百万円 716	% 10.7	百万円 2,633	百万円 -	% -

※平均保有割合 0.8%

※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。

#### ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

#### 外国リート・インデックス・マザーファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
公 社 債	百万円 -	百万円 -	百万円 100

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

種 類	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	百万円 274	百万円 79	百万円 4,209

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 300

Jリート・インデックス・マザーファンド

種 類	買 付 額
投 資 信 託 証 券	百万円 87

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	362千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	1千円
(c) (b) / (a)	0.3%

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

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況  
(2022年9月13日から2023年9月11日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2023年9月11日現在)

親投資信託残高

種 類	期 首(前期末)	期 末	評 価 額
	口 数	口 数	
	千口	千口	千円
国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	48,149	54,438	224,089
外国株式インデックス・マザーファンド	51,775	60,936	444,537
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	58,264	85,609	104,032
外国債券パッシブ・マザーファンド	158,279	208,489	439,621
国内債券パッシブ・マザーファンド	192,969	269,611	326,849
Jリート・インデックス・マザーファンド	28,910	39,990	107,194
外国リート・インデックス・マザーファンド	79,095	111,536	330,439
エマージング株式インデックス・マザーファンド	94,046	120,116	218,168

※各親投資信託の期末の受益権総口数は以下の通りです。

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	67,733,425,616口	外国株式インデックス・マザーファンド	80,285,355,686口
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	15,785,182,828口	外国債券パッシブ・マザーファンド	79,394,261,585口
国内債券パッシブ・マザーファンド	105,595,755,237口	Jリート・インデックス・マザーファンド	4,995,462,169口
外国リート・インデックス・マザーファンド	9,979,027,630口	エマージング株式インデックス・マザーファンド	20,017,222,114口

## ■ 投資信託財産の構成

(2023年9月11日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	224,089	10.1
Jリート・インデックス・マザーファンド	107,194	4.8
国内債券パッシブ・マザーファンド	326,849	14.7
外国株式インデックス・マザーファンド	444,537	20.0
外国リート・インデックス・マザーファンド	330,439	14.8
エマージング株式インデックス・マザーファンド	218,168	9.8
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	104,032	4.7
外国債券パッシブ・マザーファンド	439,621	19.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	30,769	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	2,225,702	100.0

※外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（585,531,007千円）の投資信託財産総額（585,867,614千円）に対する比率は99.9%です。

※ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（19,091,028千円）の投資信託財産総額（19,283,413千円）に対する比率は99.0%です。

※外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（166,473,428千円）の投資信託財産総額（167,423,605千円）に対する比率は99.4%です。

※外国リート・インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（29,555,271千円）の投資信託財産総額（29,578,634千円）に対する比率は99.9%です。

※エマージング株式インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（36,304,584千円）の投資信託財産総額（36,440,871千円）に対する比率は99.6%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=146.97円、1カナダ・ドル=107.84円、1オーストラリア・ドル=94.00円、1香港・ドル=18.74円、1シンガポール・ドル=107.77円、1ニュージーランド・ドル=86.80円、1台湾・ドル=4.581円、1イギリス・ポンド=183.54円、1エジプト・ポンド=4.755円、1イスラエル・シケル=38.146円、1スイス・フラン=164.78円、1トルコ・リラ=5.48円、1デンマーク・クローネ=21.12円、1ノルウェー・クローネ=13.77円、1スウェーデン・クローナ=13.24円、1メキシコ・ペソ=8.371円、1フィリピン・ペソ=2.594円、100チリ・ペソ=16.383円、100コロンビア・ペソ=3.658円、1インド・ルピー=1.78円、100インドネシア・ルピア=0.96円、1ブラジル・レアル=29.47円、1チェコ・コルナ=6.451円、100韓国・ウォン=11.02円、1オフショア・人民元=19.979円、1マレーシア・リンギット=31.446円、1南アフリカ・ランド=7.69円、1タイ・バーツ=4.14円、1ポーランド・ズロチ=34.102円、100ハンガリー・フォリント=40.921円、1ユーロ=157.48円です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年9月11日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	2, 225, 702, 820円
コール・ローン等	27, 569, 798
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	224, 089, 085
Jリート・インデックス・マザーファンド(評価額)	107, 194, 575
国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	326, 849, 689
外国株式インデックス・マザーファンド(評価額)	444, 537, 999
外国リート・インデックス・マザーファンド(評価額)	330, 439, 365
エマージング株式インデックス・マザーファンド(評価額)	218, 168, 180
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	104, 032, 432
外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	439, 621, 697
未 収 入	3, 200, 000
(B) 負 債	8, 351, 564
未 払 解 約 金	5, 928, 762
未 払 信 託 報 酬	2, 355, 378
そ の 他 未 払 費 用	67, 424
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2, 217, 351, 256
元 本	1, 577, 588, 079
次 期 繰 越 損 益 金	639, 763, 177
(D) 受 益 権 総 口 数	1, 577, 588, 079口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	14, 055円

※当期における期首元本額1,214,217,954円、期中追加設定元本額492,057,391円、期中一部解約元本額128,687,266円です。

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

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

## ■ 損益の状況

(自2022年9月13日 至2023年9月11日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 11, 201円
受 取 利 息	735
支 払 利 息	△ 11, 936
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	112, 228, 865
売 買 益	133, 098, 704
売 買 損	△ 20, 869, 839
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4, 416, 689
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	107, 800, 975
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	184, 607, 291
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	347, 354, 911
(配 当 等 相 当 額)	( 270, 905, 742)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 76, 449, 169)
(G) 合 計(D+E+F)	639, 763, 177
次 期 繰 越 損 益 金(G)	639, 763, 177
追 加 信 託 差 損 益 金	347, 354, 911
(配 当 等 相 当 額)	( 271, 764, 061)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 75, 590, 850)
分 配 準 備 積 立 金	292, 408, 266

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	42, 217, 881円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	65, 583, 094
(c) 収益調整金	347, 354, 911
(d) 分配準備積立金	184, 607, 291
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	639, 763, 177
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	4, 055. 32
(f) 分配金	0
1 万 口 当 た り 分 配 金	0

## ■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当 期
	0円

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

# 国内債券パッシブ・マザーファンド

第18期（2022年5月26日から2023年5月25日まで）

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

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

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合)		公社債 組入比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率		期中 騰落率		
14期(2019年5月27日)	12,860	1.8%	388.97	1.8%	98.7%	165,548
15期(2020年5月25日)	12,846	△0.1	388.47	△0.1	99.7	137,939
16期(2021年5月25日)	12,790	△0.4	386.73	△0.4	99.4	130,401
17期(2022年5月25日)	12,598	△1.5	380.92	△1.5	99.4	133,094
18期(2023年5月25日)	12,406	△1.5	374.83	△1.6	99.4	126,876

※NOMURA-BPI（総合）は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社およびその許諾者は、NOMURA-BPI（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社およびその許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。



## ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI (総合)		公 社 債 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2022年5月25日	円 12,598	% —	380.92	% —	% 99.4
5月末	12,552	△0.4	379.54	△0.4	99.4
6月末	12,435	△1.3	376.08	△1.3	99.4
7月末	12,518	△0.6	378.55	△0.6	99.5
8月末	12,491	△0.8	377.67	△0.9	99.4
9月末	12,358	△1.9	373.60	△1.9	99.4
10月末	12,344	△2.0	373.25	△2.0	99.5
11月末	12,284	△2.5	371.33	△2.5	99.4
12月末	12,124	△3.8	366.60	△3.8	99.4
2023年1月末	12,093	△4.0	365.59	△4.0	99.5
2月末	12,231	△2.9	369.57	△3.0	99.4
3月末	12,401	△1.6	374.74	△1.6	99.3
4月末	12,436	△1.3	375.61	△1.4	99.5
(期 末) 2023年5月25日	12,406	△1.5	374.83	△1.6	99.4

※騰落率は期首比です。

# 1 運用経過

## ▶ 基準価額等の推移について (2022年5月26日から2023年5月25日まで)

### 基準価額等の推移



期首	12,598円
期末	12,406円
騰落率	-1.5%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）です。

※NOMURA-BPI（総合）は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社およびその許諾者は、NOMURA-BPI（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社およびその許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

## ▶ 基準価額の主な変動要因 (2022年5月26日から2023年5月25日まで)

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

### 下落要因

- 世界的にインフレへの警戒が高まる中で、海外中央銀行の金融政策正常化を見込んだ海外金利の上昇に追随して、国内金利が上昇（債券価格は下落）したこと
- 日銀が金融政策により制限していた長期金利（10年国債利回り）の許容変動幅を拡大したことを背景に、国内金利が上昇したこと

### ▶ 投資環境について (2022年5月26日から2023年5月25日まで)

日本の長期金利の代表とされる10年国債利回りは上昇しました。

期初は、日銀が金融緩和政策を維持する下で日本の金利は横ばいで推移しました。その後6月には、インフレ懸念の高まりから欧米中央銀行がタカ派（インフレ抑制を重視する立場）姿勢を強める中、為替市場での円安進行も背景に、日本の金利は上昇基調に転じました。これに対し、日銀が指値オペ（日銀が指定する利回りで国債を無制限に買い入れるオペ）の対象銘柄拡大などの対応を行うとともに、緩和政策維持の姿勢を強く示したことから、日本の金利は一時的に低下しました。しかし、8月以降、インフレ長期化への警戒から欧米中央銀行がタカ派姿勢を一段と強めたことで海外金利の上昇が加速したことや、日本の物価も上振れが続いたことから、日本の金利は再び上昇基調に転じました。

12月には、日銀が金融政策決定会合で市場の予想に反し長期金利の許容変動幅を拡大したことから、日本の長期金利は急上昇しました。その後は、日銀の国債買い入れ増額や1月の金融政策決定会合での政策据え置き等により金利が一時的に低下する局面もありましたが、物価指標の市場予想比上振れや日銀の一段の政策修正への根強い警戒から、金利は高めの水準での推移が続きました。

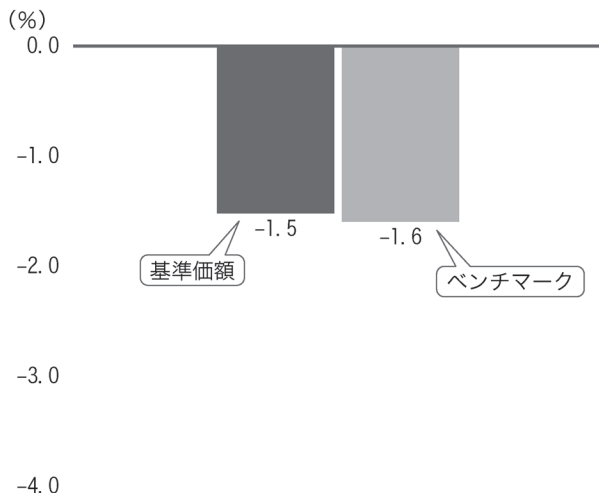
3月には、米国での銀行破綻を契機にリスク回避の動きが強まり、海外金利の低下に追随して日本の金利も急低下しました。その後、各国金融当局が金融不安の解消に向けた対応を迅速に打出したことからリスク回避の動きは和らぎましたが、欧米中央銀行の引き締めが終盤に入ってきたとの観測も広がる中で、金利の反発は限定的でした。期末にかけては、4月に植田新総裁の下で日銀が金融緩和政策の継続姿勢を示したこともあり、日本の金利は落ち着いた推移が続きました。

### ▶ ポートフォリオについて (2022年5月26日から2023年5月25日まで)

デュレーション（投資資金の平均回収期間：金利の変動による債券価格の感応度）、残存期間別配分、種別配分ともに概ねベンチマークに合わせた運用を継続しました。

## ▶ ベンチマークとの差異について (2022年5月26日から2023年5月25日まで)

## 基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

## 【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は-1.5%となり、ベンチマークの騰落率-1.6%に概ね連動した運用結果となりました。

## 2 今後の運用方針

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

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

### ■ 1万口当たりの費用明細(2022年5月26日から2023年5月25日まで)

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

期中の平均基準価額は12,348円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 当期中の売買及び取引の状況(2022年5月26日から2023年5月25日まで)

#### 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	58,419,257	62,973,666
	地方債証券	2,019,006	1,593,980
	特殊債証券	1,123,491	701,934 (337,702)
	社債証券	1,494,606	298,300

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※( )内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

※社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

### ■ 利害関係人との取引状況等(2022年5月26日から2023年5月25日まで)

#### (1) 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C	
				%				%
公社債	百万円 63,056	百万円 1,901		% 3.0	百万円 65,567	百万円 790		% 1.2

#### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

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。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

### ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2022年5月26日から2023年5月25日まで)

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

### ■ 組入れ資産の明細 (2023年5月25日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	98,332,000 (48,010,000)	100,239,605 (46,525,812)	79.0 (36.7)	— (—)	54.3 (22.3)	19.4 (9.9)	5.3 (4.4)
地 方 債 証 券	9,900,000 (9,900,000)	10,220,980 (10,220,980)	8.1 (8.1)	— (—)	3.0 (3.0)	1.9 (1.9)	3.1 (3.1)
特 殊 債 券 (除く金融債券)	8,720,913 (8,720,913)	9,216,444 (9,216,444)	7.3 (7.3)	— (—)	4.3 (4.3)	1.7 (1.7)	1.3 (1.3)
普 通 社 債 券	6,500,000 (6,500,000)	6,498,362 (6,498,362)	5.1 (5.1)	— (—)	1.9 (1.9)	2.6 (2.6)	0.6 (0.6)
合 計	123,452,913 (73,130,913)	126,175,392 (72,461,599)	99.4 (57.1)	— (—)	63.5 (31.5)	25.6 (16.2)	10.3 (9.4)

※( )内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

B 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	446 2年国債	0.0050	580,000	580,870	2025/03/01
	143 5年国債	0.1000	770,000	772,517	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	675,000	680,892	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	490,000	509,428	2025/03/20
	447 2年国債	0.0050	240,000	240,355	2025/04/01
	448 2年国債	0.0050	3,990,000	3,995,785	2025/05/01
	144 5年国債	0.1000	980,000	983,341	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	785,000	792,559	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	590,000	614,013	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	1,180,000	1,184,377	2025/09/20

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	340 10年国債	0.4000	770,000	778,223	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	620,000	651,117	2025/09/20
	146 5年国債	0.1000	1,000,000	1,003,980	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	557,000	562,085	2025/12/20
	84 20年国債	2.0000	500,000	526,440	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	1,310,000	1,312,030	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	350,000	351,480	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	645,000	684,106	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	1,130,000	1,131,559	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	310,000	311,333	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	742,000	795,342	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	20,000	21,376	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	1,240,000	1,241,227	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	811,000	814,365	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	580,000	622,885	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	1,230,000	1,230,651	2026/12/20
	345 10年国債	0.1000	258,000	259,011	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	324,000	348,413	2026/12/20
	151 5年国債	0.0050	230,000	230,000	2027/03/20
	152 5年国債	0.1000	340,000	341,230	2027/03/20
	346 10年国債	0.1000	340,000	341,230	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	632,000	680,107	2027/03/20
	153 5年国債	0.0050	1,140,000	1,139,065	2027/06/20
	347 10年国債	0.1000	100,000	100,304	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	305,000	333,200	2027/06/20
	154 5年国債	0.1000	1,020,000	1,022,193	2027/09/20
	348 10年国債	0.1000	145,000	145,311	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	327,000	357,309	2027/09/20
	156 5年国債	0.2000	1,220,000	1,226,380	2027/12/20
	349 10年国債	0.1000	550,000	550,500	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	153,000	167,109	2027/12/20
	157 5年国債	0.2000	570,000	572,456	2028/03/20
	350 10年国債	0.1000	510,000	509,877	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	207,000	227,836	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	355,000	394,135	2028/03/20
	351 10年国債	0.1000	450,000	449,545	2028/06/20
	102 20年国債	2.4000	457,000	509,618	2028/06/20
	352 10年国債	0.1000	230,000	229,574	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	370,000	408,513	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	370,000	410,466	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	500,000	498,755	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	378,000	418,944	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	705,000	702,758	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	140,000	154,126	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	600,000	597,654	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	386,000	433,454	2029/06/20

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	356 10年国債	0.1000	750,000	746,250	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	227,000	254,394	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	1,030,000	1,023,644	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	263,000	295,690	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	510,000	584,806	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	940,000	932,733	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	100,000	113,411	2030/03/20
	359 10年国債	0.1000	1,000,000	990,610	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	200,000	224,700	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	295,000	327,326	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	200,000	219,134	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	910,000	899,535	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	55,000	61,546	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	330,000	366,900	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	340,000	406,072	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	980,000	966,564	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	80,000	90,860	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	190,000	214,382	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	1,150,000	1,131,991	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	205,000	235,016	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	180,000	203,603	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	145,000	162,904	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	290,000	332,957	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	1,610,000	1,581,503	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	65,000	73,164	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	890,000	872,716	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	155,000	173,592	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	380,000	422,499	2031/09/20
	365 10年国債	0.1000	910,000	891,062	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	450,000	501,376	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	190,000	213,276	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	200,000	224,994	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	155,000	173,043	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	120,000	132,942	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	474,000	554,982	2032/05/20
	367 10年国債	0.2000	750,000	738,487	2032/06/20
	137 20年国債	1.7000	185,000	206,859	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	60,000	66,562	2032/06/20
	368 10年国債	0.2000	500,000	491,455	2032/09/20
	140 20年国債	1.7000	420,000	470,328	2032/09/20
	369 10年国債	0.5000	1,110,000	1,120,223	2032/12/20
	9 30年国債	1.4000	240,000	262,360	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	360,000	403,693	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	240,000	271,344	2032/12/20
	370 10年国債	0.5000	780,000	785,506	2033/03/20
	10 30年国債	1.1000	465,000	495,043	2033/03/20



## 国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	143 20年国債	1. 6000	150, 000	166, 843	2033/03/20
	144 20年国債	1. 5000	170, 000	187, 484	2033/03/20
	11 30年国債	1. 7000	430, 000	482, 933	2033/06/20
	145 20年国債	1. 7000	110, 000	123, 541	2033/06/20
	12 30年国債	2. 1000	570, 000	663, 405	2033/09/20
	146 20年国債	1. 7000	195, 000	219, 146	2033/09/20
	147 20年国債	1. 6000	260, 000	289, 728	2033/12/20
	14 30年国債	2. 4000	392, 000	469, 870	2034/03/20
	148 20年国債	1. 5000	319, 000	352, 274	2034/03/20
	149 20年国債	1. 5000	495, 000	546, 628	2034/06/20
	16 30年国債	2. 5000	445, 000	540, 065	2034/09/20
	150 20年国債	1. 4000	451, 000	493, 163	2034/09/20
	151 20年国債	1. 2000	840, 000	899, 875	2034/12/20
	18 30年国債	2. 3000	190, 000	227, 268	2035/03/20
	152 20年国債	1. 2000	410, 000	439, 081	2035/03/20
	19 30年国債	2. 3000	470, 000	563, 083	2035/06/20
	153 20年国債	1. 3000	527, 000	570, 113	2035/06/20
	154 20年国債	1. 2000	440, 000	470, 553	2035/09/20
	21 30年国債	2. 3000	345, 000	414, 520	2035/12/20
	155 20年国債	1. 0000	410, 000	428, 417	2035/12/20
	22 30年国債	2. 5000	315, 000	386, 687	2036/03/20
	156 20年国債	0. 4000	60, 000	58, 190	2036/03/20
	23 30年国債	2. 5000	299, 000	367, 620	2036/06/20
	157 20年国債	0. 2000	495, 000	466, 483	2036/06/20
	24 30年国債	2. 5000	310, 000	381, 709	2036/09/20
	158 20年国債	0. 5000	380, 000	371, 415	2036/09/20
	25 30年国債	2. 3000	290, 000	350, 102	2036/12/20
	159 20年国債	0. 6000	388, 000	383, 188	2036/12/20
	26 30年国債	2. 4000	363, 000	443, 535	2037/03/20
	160 20年国債	0. 7000	295, 000	294, 628	2037/03/20
	161 20年国債	0. 6000	730, 000	717, 889	2037/06/20
	27 30年国債	2. 5000	250, 000	309, 577	2037/09/20
	162 20年国債	0. 6000	410, 000	402, 046	2037/09/20
	163 20年国債	0. 6000	430, 000	420, 419	2037/12/20
	28 30年国債	2. 5000	96, 000	119, 116	2038/03/20
	164 20年国債	0. 5000	475, 000	456, 726	2038/03/20
	165 20年国債	0. 5000	410, 000	392, 927	2038/06/20
	29 30年国債	2. 4000	157, 000	192, 861	2038/09/20
	166 20年国債	0. 7000	445, 000	438, 026	2038/09/20
	167 20年国債	0. 5000	480, 000	457, 209	2038/12/20
	30 30年国債	2. 3000	212, 000	257, 730	2039/03/20
	168 20年国債	0. 4000	450, 000	420, 885	2039/03/20
	169 20年国債	0. 3000	400, 000	366, 820	2039/06/20
	31 30年国債	2. 2000	235, 000	282, 493	2039/09/20
	170 20年国債	0. 3000	405, 000	369, 890	2039/09/20
	171 20年国債	0. 3000	385, 000	350, 427	2039/12/20

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	32 30年国債	2.3000	360,000	438,415	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	480,000	442,680	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	445,000	409,052	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	368,000	431,240	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	580,000	531,367	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	565,000	524,738	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	87,000	104,687	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	670,000	620,272	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	590,000	535,006	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	340,000	398,191	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	500,000	460,220	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	400,000	367,236	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	90,000	105,505	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	500,000	483,395	2042/03/20
	181 20年国債	0.9000	450,000	442,084	2042/06/20
	37 30年国債	1.9000	385,000	444,705	2042/09/20
	182 20年国債	1.1000	410,000	416,301	2042/09/20
	183 20年国債	1.4000	440,000	469,189	2042/12/20
	38 30年国債	1.8000	220,000	249,933	2043/03/20
	184 20年国債	1.1000	430,000	434,953	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	220,000	253,941	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	240,000	272,654	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	240,000	268,202	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	280,000	312,958	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	225,000	251,532	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	290,000	323,964	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	315,000	339,629	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	315,000	339,557	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	540,000	592,147	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	110,000	116,226	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	345,000	364,371	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	325,000	303,891	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	265,000	220,514	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	213,000	185,324	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	277,000	246,009	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	105,000	97,309	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	415,000	383,638	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	320,000	295,068	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	305,000	280,517	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	40,000	50,432	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	420,000	385,295	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	280,000	250,126	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	310,000	289,130	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	285,000	252,424	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	242,000	293,751	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	235,000	197,134	2049/03/20

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	63 30年国債	0.4000	230,000	186,964	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	315,000	255,150	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	235,000	190,039	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	185,000	224,353	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	310,000	249,314	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	320,000	270,809	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	390,000	328,992	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	310,000	268,165	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	247,000	299,761	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	350,000	302,463	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	370,000	319,417	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	340,000	293,219	2051/09/20
	73 30年国債	0.7000	300,000	258,462	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	235,000	275,253	2052/03/20
	74 30年国債	1.0000	320,000	298,000	2052/03/20
	75 30年国債	1.3000	210,000	210,665	2052/06/20
	76 30年国債	1.4000	370,000	380,274	2052/09/20
	77 30年国債	1.6000	350,000	376,446	2052/12/20
	6 40年国債	1.9000	240,000	275,980	2053/03/20
	78 30年国債	1.4000	260,000	267,020	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	265,000	291,852	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	270,000	276,385	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	473,000	358,183	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	450,000	398,817	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	340,000	290,547	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	370,000	283,131	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	505,000	382,951	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	455,000	368,054	2061/03/20
	15 40年国債	1.0000	580,000	513,897	2062/03/20
	小 計	-	98,332,000	100,239,605	-
地方債証券	377 大阪府公債	0.7290	100,000	100,309	2023/10/30
	25-8 千葉県公債	0.6700	100,000	100,339	2023/11/24
	727 東京都公債	0.7200	500,000	502,101	2023/12/20
	1 名古屋市20年	1.9900	200,000	202,294	2023/12/20
	25-11 福岡県公債	0.6940	100,000	100,541	2024/02/26
	1-1 大阪市5年	0.0100	300,000	300,004	2024/05/21
	208 神奈川県公債	0.5510	200,000	201,178	2024/06/20
	1 神奈川県20年	2.5500	100,000	102,723	2024/06/20
	26-4 札幌市公債	0.5400	100,000	100,568	2024/06/20
	26-4 神戸市公債	0.6060	200,000	201,380	2024/07/18
	26-3 横浜市公債	0.5710	200,000	201,406	2024/08/19
	137 共同発行地方	0.5660	200,000	201,407	2024/08/23
	26-3 福岡県公債	0.5620	100,000	100,703	2024/08/27
	1-6 京都府5年	0.0010	200,000	199,994	2024/09/19
	26-4 千葉県公債	0.5540	100,000	100,735	2024/09/25
	138 共同発行地方	0.5540	200,000	201,470	2024/09/25

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	1-2 北九州市5年	0.0010	100,000	99,997	2024/09/26
	388 大阪府公債	0.5400	100,000	100,676	2024/09/27
	210 神奈川県公債	0.4510	100,000	100,677	2024/12/20
	211 神奈川県公債	0.4380	100,000	100,657	2024/12/20
	26-17 神戸市公債	0.2800	100,000	100,415	2025/01/27
	392 大阪府公債	0.3600	100,000	100,495	2025/01/29
	26-10 福岡県公債	0.4530	100,000	100,731	2025/02/26
	26-15 北海道公債	0.4340	100,000	100,631	2025/02/27
	6 東京都20年	2.0000	100,000	103,555	2025/03/19
	4 横浜市20年	2.0300	100,000	103,606	2025/03/19
	27-4 京都府公債	0.5530	100,000	101,039	2025/06/19
	3 神奈川県20年	2.1100	100,000	104,255	2025/06/20
	3 名古屋市20年	2.0300	100,000	104,096	2025/06/20
	27-3 千葉県公債	0.5240	100,000	100,980	2025/06/25
	1 静岡県20年	2.1800	100,000	104,915	2025/09/19
	7 横浜市20年	2.0600	100,000	105,128	2025/12/19
	27-16 愛知県公債	0.4540	400,000	404,045	2025/12/25
	155 共同発行地方	0.2200	100,000	100,413	2026/02/25
	9 横浜市20年	2.3500	100,000	106,954	2026/06/19
	5 名古屋市20年	2.3000	100,000	107,314	2026/09/18
	7 神奈川県20年	2.2200	100,000	107,945	2027/03/19
	193 大阪府5年	0.0010	300,000	298,096	2027/03/30
	172 共同発行地方	0.2250	500,000	501,405	2027/07/23
	5 埼玉県20年	2.3500	100,000	110,130	2028/03/17
	14 横浜市20年	2.3200	100,000	109,993	2028/03/17
	5 兵庫県公債15年	1.3100	300,000	315,442	2028/05/26
	183 共同発行地方	0.2050	600,000	598,852	2028/06/23
	7 京都市20年	2.3800	100,000	111,131	2028/09/21
	30-18 北海道公債	0.1460	200,000	198,005	2029/02/28
	1-1 福岡県公債	0.0290	200,000	196,592	2029/06/21
	199 共同発行地方	0.0500	100,000	98,191	2029/10/25
	13 神奈川県20年	2.2100	100,000	112,065	2029/12/20
	10兵庫県公債20年	2.2400	100,000	112,253	2030/02/22
	22-8 愛知県20年	1.8910	200,000	221,079	2030/09/13
	94 川崎市公債	0.1050	100,000	96,651	2031/09/19
	2 埼玉県公債	0.7060	300,000	299,293	2033/05/20
	1 東京都30年	2.2100	100,000	114,454	2033/06/20
	1 京都市30年	2.5700	100,000	121,755	2037/09/18
	8 東京都30年	2.2300	400,000	469,093	2038/09/17
	13 東京都30年	1.9300	500,000	567,084	2042/03/19
	7 静岡県30年	1.9880	100,000	114,504	2043/06/19
	1-3 福岡県30年	0.4320	100,000	79,213	2049/06/18
	小 計	-	9,900,000	10,220,980	-
特 殊 債 券 (除く金融債券)	5 公営企業20年	2.1100	100,000	100,664	2023/09/20
	3 政保政策投資CO	2.1000	200,000	202,452	2023/12/18
	61 地方公共団体	0.6900	100,000	100,699	2024/06/28

# 国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	62 地方公共団体	0.6310	400,000	402,683	2024/07/26
	63 地方公共団体	0.5810	100,000	100,654	2024/08/28
	64 地方公共団体	0.5740	100,000	100,685	2024/09/27
	227 政保道路機構	0.5440	200,000	201,570	2024/09/30
	231 政保道路機構	0.4950	300,000	302,355	2024/11/29
	67政保地方公共団	0.4660	100,000	100,755	2024/12/13
	76政保地方公共団	0.4250	300,000	302,790	2025/09/12
	85 中日本高速道	0.0700	300,000	299,235	2025/10/21
	17 公営企業20年	2.3900	100,000	106,255	2026/03/24
	288 政保道路機構	0.0100	189,000	188,737	2026/09/30
	93 住宅支援機構	1.5570	100,000	104,870	2026/12/18
	20 公営企業20年	2.2500	100,000	107,685	2027/03/24
	36 日本政策投資B	2.2300	100,000	107,904	2027/05/28
	22 公営企業20年	2.3200	100,000	108,361	2027/06/18
	27 道路機構	2.3400	100,000	109,014	2027/10/20
	101 地方公共団体	0.2350	100,000	99,790	2027/10/28
	124 住宅支援機構	1.4280	100,000	105,178	2027/12/20
	226 住宅支援機構	0.2400	100,000	99,783	2027/12/20
	106 地方公共団体	0.2150	200,000	198,880	2028/03/28
	24 公営企業20年	2.2900	200,000	219,065	2028/04/25
	37 道路機構	2.4200	300,000	331,306	2028/06/20
	47 道路機構	2.4100	200,000	223,544	2029/04/20
	79 政保道路機構	2.1000	200,000	221,750	2029/04/27
	2 地方公営20年	2.2900	100,000	111,095	2029/04/27
	81 政保道路機構	2.1000	200,000	221,999	2029/05/31
	47日本政策投資CO	1.0270	100,000	103,783	2029/09/20
	90 政保道路機構	2.1000	500,000	557,344	2029/09/28
	99 政保道路機構	2.2000	100,000	112,557	2030/01/31
	52 住宅支援機構	2.0100	100,000	110,730	2030/07/16
	117 都市再生	0.8040	100,000	102,096	2030/11/20
	9 道路債券	2.9000	100,000	119,655	2032/05/20
	176 政保道路機構	1.6450	100,000	109,917	2032/10/29
	130 住宅支援機構	1.7630	200,000	219,252	2032/12/20
	196 政保道路機構	1.7790	100,000	110,885	2033/07/29
	210 政保道路機構	1.5470	200,000	217,754	2034/01/31
	S3 住宅機構RMBS	2.0900	9,776	9,840	2037/11/10
	S5 住宅機構RMBS	1.9600	20,768	20,894	2038/11/10
	S7 住宅機構RMBS	2.0000	10,629	10,771	2038/11/10
	S9 住宅機構RMBS	2.2400	10,897	11,064	2039/05/10
	88 政保道路機構	2.3000	100,000	120,723	2039/08/31
	S10 住宅機構RMBS	2.0900	10,722	10,871	2039/11/10
	S11 住宅機構RMBS	2.1200	11,547	11,798	2040/05/10
	35 住宅金融RMBS	1.7900	10,434	10,488	2040/10/10
	41 住宅金融RMBS	2.0900	10,213	10,276	2041/04/10
	53 住宅金融RMBS	2.0900	10,077	10,141	2042/04/10
	2 住宅機構RMBS	2.1900	20,760	20,905	2042/06/10

# 国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	19 住宅機構RMBS	2.1500	13,933	14,451	2043/11/10
	24 住宅機構RMBS	2.3400	28,182	29,368	2044/05/10
	26 住宅機構RMBS	2.1400	44,538	46,435	2044/07/10
	27 住宅機構RMBS	2.0500	15,595	16,296	2044/08/10
	28 住宅機構RMBS	1.9800	18,166	19,139	2044/09/10
	29 住宅機構RMBS	1.9500	19,700	20,813	2044/10/10
	30 住宅機構RMBS	1.9700	19,307	20,392	2044/11/10
	32 住宅機構RMBS	1.8200	38,134	40,017	2045/01/10
	35 住宅機構RMBS	1.8700	19,413	20,401	2045/04/10
	36 住宅機構RMBS	1.8100	18,640	19,523	2045/05/10
	43 住宅機構RMBS	1.6000	23,931	25,108	2045/12/10
	46 住宅機構RMBS	1.8500	18,639	19,554	2046/03/10
	48 住宅機構RMBS	1.8900	35,192	36,874	2046/05/10
	49 住宅機構RMBS	1.7600	17,985	18,785	2046/06/10
	51 住宅機構RMBS	1.6400	39,120	40,833	2046/08/10
	55 住宅機構RMBS	1.4100	52,442	54,597	2046/12/10
	18 道路機構	2.8700	100,000	129,355	2046/12/20
	57 住宅機構RMBS	1.4400	25,068	26,113	2047/02/10
	58 住宅機構RMBS	1.4000	28,019	29,195	2047/03/10
	22 道路機構	2.6700	300,000	375,890	2047/03/20
	59 住宅機構RMBS	1.4400	53,382	55,677	2047/04/10
	60 住宅機構RMBS	1.3400	81,207	84,357	2047/05/10
	61 住宅機構RMBS	1.2600	27,334	28,301	2047/06/10
	67 住宅機構RMBS	1.0900	34,688	35,634	2047/12/10
	69 住宅機構RMBS	1.2800	72,386	75,042	2048/02/10
	70 住宅機構RMBS	1.2500	62,950	65,159	2048/03/10
	73 住宅機構RMBS	1.3000	35,997	37,350	2048/06/10
	99 住宅機構RMBS	0.8800	55,726	56,450	2050/08/10
	123 住宅機構RMBS	0.4600	73,405	71,914	2052/08/10
	124 住宅機構RMBS	0.4200	73,239	71,532	2052/09/10
	125 住宅機構RMBS	0.4200	73,252	71,559	2052/10/10
	127 住宅機構RMBS	0.4000	75,295	73,344	2052/12/10
	128 住宅機構RMBS	0.4200	74,080	72,316	2053/01/10
	129 住宅機構RMBS	0.4600	75,805	74,152	2053/02/10
	137 住宅機構RMBS	0.4700	78,202	76,348	2053/10/10
	167 住宅機構RMBS	0.4100	91,014	87,746	2056/04/10
	183 住宅機構RMBS	0.5300	194,060	188,005	2057/08/10
	186 住宅機構RMBS	0.7400	98,064	96,877	2057/11/10
	小 計	-	8,720,913	9,216,444	-
普通社債券	2 BPCE S.A.	0.6450	200,000	200,000	2023/07/12
	1 野村ホールディングス	0.3000	100,000	99,950	2023/09/04
	20 西日本高速道	0.7590	100,000	100,218	2023/09/20
	16 日立製作所	0.8130	100,000	100,390	2023/12/13
	23 西日本高速道	0.6020	100,000	100,549	2024/06/20
	1 みずほFG劣後	0.9500	100,000	100,281	2024/07/16
	1 三井住友FG劣後	0.8490	100,000	100,275	2024/09/12

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	64 阪急阪神HLDG	0.1000	100,000	99,347	2026/12/08
	86 東日本高速道	0.0400	200,000	198,530	2026/12/18
	73 ホンダファイナンス	0.1000	200,000	198,253	2026/12/18
	553 中部電力	0.2500	200,000	199,282	2027/02/25
	2 三菱HCキャピタル	0.1900	200,000	197,781	2027/03/01
	63 三井物産	2.3700	100,000	107,717	2027/04/23
	9 みずほ銀行劣後	2.5200	100,000	106,356	2027/04/27
	8 住友信託 劣後	2.4900	100,000	106,366	2027/05/10
	550 関西電力	0.3900	300,000	299,822	2027/05/25
	13 大和ハウス	0.2850	100,000	99,853	2027/06/01
	17 アサヒグループHD	0.2900	200,000	199,706	2027/06/01
	207 オリックス	0.3500	200,000	198,625	2027/06/15
	30 東レ	0.3750	100,000	100,040	2027/07/16
	8 みずほコーポレート	2.5400	100,000	108,979	2027/07/27
	56 住友化学	0.3800	200,000	199,223	2027/09/13
	56 東京電力PG	0.9800	200,000	201,543	2027/10/19
	31 KDDI	0.4300	200,000	199,982	2027/10/27
	38 京王電鉄	0.2950	100,000	99,703	2027/11/29
	17 NTTファイナンス	0.2800	200,000	198,734	2027/12/20
	22 パナソニック	0.2900	100,000	98,766	2027/12/24
	24三菱ケミカルホールデイ	0.3700	100,000	99,217	2028/02/25
	7 ファーストリテイリング	0.4050	100,000	99,427	2028/06/06
	9 TDK	0.2600	100,000	98,219	2028/12/01
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	109,334	2029/01/29
	42 東海旅客鉄道	2.3120	100,000	110,430	2029/04/24
	508 東北電力	0.4650	200,000	198,924	2029/04/25
	547 東北電力	0.5000	100,000	99,554	2029/06/25
	60 西日本旅客鉄	0.2550	200,000	194,631	2030/05/21
	45 東京地下鉄	0.2150	100,000	96,629	2030/09/18
	41 大阪瓦斯	0.2200	200,000	190,977	2031/06/03
	135 三菱地所	0.2600	200,000	192,424	2031/06/20
	169 東日本旅客鉄	0.1650	200,000	190,271	2031/07/15
	546 中部電力	0.2800	200,000	191,348	2031/09/25
	496 九州電力	0.3300	300,000	287,295	2031/10/24
	10 東急	0.2400	100,000	95,621	2031/12/09
	58 三菱地所	2.9000	100,000	118,184	2032/05/20
	110東日本旅客鉄	1.7600	100,000	105,586	2045/07/28
	小 計	—	6,500,000	6,498,362	—
	合 計	—	123,452,913	126,175,392	—

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

### ■ 投資信託財産の構成

(2023年5月25日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	126,175,392	99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	734,112	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	126,909,505	100.0

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年5月25日現在)

項 目	期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>126,909,505,575円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	435,023,963
公 社 債 ( 評 価 額 )	126,175,392,686
未 収 利 息	287,241,203
前 払 費 用	11,847,723
<b>(B) 負 債</b>	<b>33,489,380</b>
未 払 金	18,487,800
未 払 解 約 金	15,000,000
そ の 他 未 払 費 用	1,580
<b>(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )</b>	<b>126,876,016,195</b>
元 本	102,269,168,472
次 期 繰 越 損 益 金	24,606,847,723
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>102,269,168,472口</b>
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 ( C / D )	12,406円

※当期における期首元本額105,645,341,665円、期中追加設定元本額27,564,297,171円、期中一部解約元本額30,940,470,364円です。  
 ※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。  
 ※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

### ■ 損益の状況

(自2022年5月26日 至2023年5月25日)

項 目	当 期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>1,110,963,838円</b>
受 取 利 息	1,111,238,739
支 払 利 息	△ 274,901
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>△ 3,268,899,578</b>
売 買 損 益	259,169,207
売 買 損 益	△ 3,528,068,785
<b>(C) そ の 他 費 用 等</b>	<b>△ 25,447</b>
<b>(D) 当 期 損 益 金 ( A + B + C )</b>	<b>△ 2,157,961,187</b>
<b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>27,449,593,454</b>
<b>(F) 解 約 差 損 益 金</b>	<b>△ 7,166,945,374</b>
<b>(G) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>6,482,160,830</b>
<b>(H) 合 計 ( D + E + F + G )</b>	<b>24,606,847,723</b>
次 期 繰 越 損 益 金 ( H )	24,606,847,723

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



## 国内債券パッシブ・マザーファンド

### ■ 期末における、元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	8,228,922,952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）	97,059円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	13,134,301,772円	三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	54,198円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,182,708,642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）	12,947円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	745,965,814円	SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,128,704,106円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	41,546,803円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	9,611,550,076円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	183,035,032円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,706,550,972円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	568,361,770円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,453,739,819円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	1,040,005,403円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	291,755,610円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	569,078,686円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	466,061,460円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	683,103,280円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	259,299,911円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	143,704,113円	SMAM・バランスファンドVLI国際分散型<適格機関投資家限定>	116,608,704円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,537,044,923円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,681,190,812円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,079,540,918円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,969,539,677円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	422,842,549円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,120,208,354円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	73,606,082円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,485,323,540円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	2,331,246,647円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	961,967円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	792,012,857円	三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,024,959,097円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	1,208,534,019円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	369,354,331円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	278,718,928円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	475,881,321円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	45,885,042円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	162,026,305円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	235,812,075円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	44,327,528円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	334,431,985円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,232,081,197円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	677,515,441円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,957,765,867円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	200,483,082円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	594,658,223円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	9,860,291円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	204,865,104円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	378,895円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	20,783,621円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	323,471円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	250,396,742円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	226,352円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,606,882,033円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	113,477円	SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,059,295,702円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	113,477円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,012,726,783円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	215,601円	SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,296,116,779円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	144,709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>	3,915,603,539円

### ■ お知らせ

#### <約款変更について>

該当事項はございません。

# ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

第20期（2022年8月26日から2023年8月25日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年10月3日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。</li> <li>・ 保有する外貨建資産については、為替のフルヘッジを原則とします。</li> </ul>

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

## ■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ換算ベース)		公社入比率	純資産額
	騰落	率	騰落	率		
	円	%		%	%	百万円
16期(2019年8月26日)	14,894	8.2	414.04	8.4	94.6	27,583
17期(2020年8月25日)	15,423	3.6	428.86	3.6	98.4	23,201
18期(2021年8月25日)	15,251	△1.1	423.79	△1.2	98.4	26,330
19期(2022年8月25日)	13,216	△13.3	367.05	△13.4	100.9	26,492
20期(2023年8月25日)	12,197	△7.7	339.19	△7.6	100.4	18,975

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

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

## ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

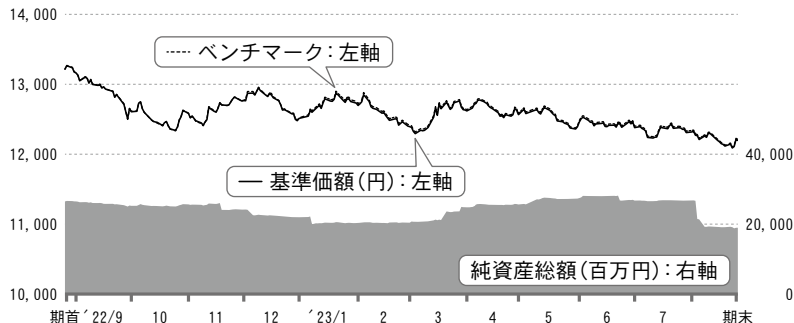
年月日	基準価額		(ベンチマーク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ換算ベース)		公社入比率
	騰落	率	騰落	率	
(期首) 2022年8月25日	円	%		%	%
	13,216	—	367.05	—	100.9
8月末	13,162	△0.4	365.57	△0.4	101.8
9月末	12,607	△4.6	350.26	△4.6	101.5
10月末	12,583	△4.8	349.59	△4.8	101.3
11月末	12,767	△3.4	354.67	△3.4	94.0
12月末	12,512	△5.3	347.74	△5.3	96.6
2023年1月末	12,697	△3.9	353.36	△3.7	98.2
2月末	12,394	△6.2	344.92	△6.0	102.1
3月末	12,619	△4.5	350.96	△4.4	98.8
4月末	12,566	△4.9	349.53	△4.8	100.0
5月末	12,460	△5.7	346.62	△5.6	100.3
6月末	12,380	△6.3	344.37	△6.2	103.4
7月末	12,318	△6.8	342.72	△6.6	96.5
(期末) 2023年8月25日	12,197	△7.7	339.19	△7.6	100.4

※騰落率は期首比です。

# 1 運用経過

## ▶ 基準価額等の推移について（2022年8月26日から2023年8月25日まで）

### 基準価額等の推移



期首	13,216円
期末	12,197円
騰落率	-7.7%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

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

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

## ▶ 基準価額の主な変動要因（2022年8月26日から2023年8月25日まで）

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

### 下落要因

- ・インフレ懸念が継続し、主要国の中銀による金融引き締めが継続される中、米欧金利（債券価格は下落）が上昇したこと

### ▶ 投資環境について（2022年8月26日から2023年8月25日まで）

債券市場は米国、欧州ともに大幅に下落しました。

#### 債券市場

米国や欧州の長期金利（10年国債利回り）は上昇しました。インフレ懸念が継続し、主要国の中銀による金融引き締めが継続される中、米欧金利は上昇しました。

中には、シリコンバレー銀行の破綻をきっかけに米欧の金融不安が高まった局面では金利低下も見られましたが、懸念が和らぎ再びインフレや景気の底堅さに注目が戻る中で、金利は上昇しました。

### ▶ ポートフォリオについて（2022年8月26日から2023年8月25日まで）

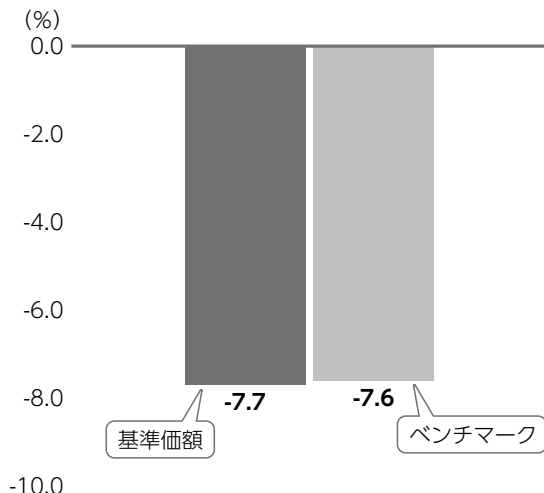
#### 債券組入比率

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。インデックス構成銘柄の変更が実施される毎月末において、ファンドの特性値（通貨・国別配分、満期構成、デュレーション（投資資金の平均回収期間：金利の変動による債券価格の感応度）等）をベンチマークに合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資配分比率の調整）を行いました。

また、組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

## ▶ ベンチマークとの差異について（2022年8月26日から2023年8月25日まで）

## 基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

記載のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

## 【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は-7.7%となり、ベンチマークの騰落率-7.6%に概ね連動する結果となりました。

## 2 今後の運用方針

米欧では中央銀行がインフレ抑制を優先する姿勢を当面継続することが予想されます。ただし、今後は徐々にインフレがピークアウトし、累積した利上げの効果による景気減速が進むことが想定されることから、金利は緩やかに低下する展開を予想します。

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

なお、組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

### ■ 1万口当たりの費用明細 (2022年8月26日から2023年8月25日まで)

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

期中の平均基準価額は12,579円です。

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

### ■ 当期中の売買及び取引の状況 (2022年8月26日から2023年8月25日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ 国 債 証 券	千アメリカ・ドル 58,403	千アメリカ・ドル 90,497
	カ ナ ダ 国 債 証 券	千カナダ・ドル 2,723	千カナダ・ドル 4,458
	オーストラリア 国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 1,915	千オーストラリア・ドル 3,234
	シンガポール 国 債 証 券	千シンガポール・ドル 908	千シンガポール・ドル 1,766
	ニュージーランド 国 債 証 券	千ニュージーランド・ドル 969	千ニュージーランド・ドル 456
	イギリス 国 債 証 券	千イギリス・ポンド 4,004	千イギリス・ポンド 5,545
	イスラエル 国 債 証 券	千イスラエル・シュケル 1,070	千イスラエル・シュケル 2,119
	デンマーク 国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 1,208	千デンマーク・クローネ 3,273
	ノルウェー 国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 883	千ノルウェー・クローネ 2,495
	スウェーデン 国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 1,062	千スウェーデン・クローナ 3,430
	メキシコ 国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 12,446	千メキシコ・ペソ 21,021
	中 国 国 債 証 券	千オフショア・人民元 75,500	千オフショア・人民元 52,609
	ポーランド 国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 1,567	千ポーランド・ズロチ 3,012
	国	ユ ー ロ 国 債 証 券	千ユーロ
アイルランド 国 債 証 券		249	684
オランダ 国 債 証 券		1,123	2,207
ベルギー 国 債 証 券		1,362	2,596
フランス 国 債 証 券		5,745	11,487
ドイツ 国 債 証 券		5,299	9,082
スペイン 国 債 証 券		3,522	6,851
イタリア 国 債 証 券		5,933	11,397
フィンランド 国 債 証 券		260	564
オーストリア 国 債 証 券		662	1,393

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2022年8月26日から2023年8月25日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

### ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2022年8月26日から2023年8月25日まで)

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

### ■ 組入れ資産の明細 (2023年8月25日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	額面金額	期 末		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 71,650	千アメリカ・ドル 63,263	千円 9,250,338	48.7	—	20.5	17.1	11.1
カナダ	千カナダ・ドル 3,930	千カナダ・ドル 3,520	379,005	2.0	—	1.0	0.6	0.3
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 3,350	千オーストラリア・ドル 2,965	278,221	1.5	—	1.0	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 1,810	千シンガポール・ドル 1,719	185,408	1.0	—	0.7	0.2	0.1
ニュージーランド	千ニューージーランド・ドル 610	千ニューージーランド・ドル 491	42,509	0.2	—	0.1	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 6,450	千イギリス・ポンド 5,117	942,188	5.0	—	3.5	1.3	0.1
イスラエル	千イスラエル・シケル 1,670	千イスラエル・シケル 1,500	57,872	0.3	—	0.2	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 3,100	千デンマーク・クローネ 2,919	61,831	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 2,540	千ノルウェー・クローネ 2,289	31,184	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 2,960	千スウェーデン・クローナ 2,735	36,379	0.2	—	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 24,520	千メキシコ・ペソ 22,547	195,996	1.0	—	0.6	0.3	0.1
中国	千オフショア・人民元 57,300	千オフショア・人民元 58,543	1,174,683	6.2	—	2.8	3.0	0.4
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 2,990	千ポーランド・ズロチ 2,714	95,722	0.5	—	0.2	0.2	0.2
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
アイルランド	860	735	116,084	0.6	—	0.4	0.1	0.0
オランダ	2,100	1,810	285,740	1.5	—	1.0	0.4	0.1
ベルギー	2,540	2,223	350,940	1.8	—	1.2	0.4	0.2
フランス	11,150	10,022	1,582,098	8.3	—	5.0	2.8	0.6
ドイツ	8,580	7,957	1,256,183	6.6	—	3.5	1.9	1.2
スペイン	6,590	5,949	939,210	4.9	—	2.8	1.6	0.6
イタリア	9,830	9,199	1,452,184	7.7	—	4.2	2.4	1.0
フィンランド	790	641	101,230	0.5	—	0.4	0.1	0.0
オーストラリア	1,720	1,468	231,773	1.2	—	0.7	0.4	0.1
合 計	—	—	19,046,789	100.4	—	50.1	33.9	16.4

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示  
外国(外貨建)公社債

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	290	227	33,261	2043/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	230	202	29,626	2043/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	300	253	37,023	2044/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	270	237	34,675	2044/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	320	259	37,886	2044/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	220	174	25,444	2044/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	220	158	23,220	2045/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	290	228	33,421	2045/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	110	84	12,377	2045/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	340	243	35,532	2046/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	120	110	16,159	2026/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	230	164	24,003	2046/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	250	169	24,739	2046/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	490	451	66,007	2026/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	150	117	17,147	2047/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	300	234	34,274	2047/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	250	186	27,221	2047/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	250	186	27,199	2047/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	420	390	57,163	2028/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	360	280	41,064	2048/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	420	335	49,038	2048/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	300	288	42,142	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	300	279	40,843	2028/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	620	595	87,143	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	100	94	13,751	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	300	250	36,662	2048/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	110	104	15,294	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	230	218	31,940	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	370	288	42,241	2049/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	50	47	6,878	2026/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	300	269	39,421	2029/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	410	312	45,709	2049/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	320	298	43,661	2026/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	200	185	27,075	2026/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	220	188	27,615	2029/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	240	217	31,862	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	50	47	7,014	2024/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	110	100	14,696	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	180	123	18,073	2049/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	350	318	46,562	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	570	479	70,058	2030/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	470	295	43,176	2050/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	280	248	36,399	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	920	854	124,984	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	120	104	15,270	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	550	496	72,563	2027/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	390	372	54,428	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	300	235	34,446	2030/05/15



## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	230	117	17,224	2050/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	370	339	49,713	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	50	30	4,452	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	40	34	5,035	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	520	480	70,266	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	30	25	3,788	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	650	595	87,086	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	310	266	38,923	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	350	319	46,730	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	400	340	49,812	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	750	584	85,516	2030/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	450	238	34,884	2050/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	160	96	14,117	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	340	290	42,430	2027/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	590	536	78,502	2025/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	290	263	38,502	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	470	397	58,181	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	280	221	32,418	2030/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	310	175	25,726	2050/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	790	635	92,870	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	640	387	56,678	2051/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	300	269	39,427	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	460	391	57,260	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	510	461	67,423	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	500	451	65,973	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	280	238	34,835	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	350	297	43,440	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	540	466	68,259	2028/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	50	31	4,592	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	200	136	19,992	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	550	494	72,296	2026/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	400	339	49,639	2027/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	420	379	55,551	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	530	478	70,022	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	460	399	58,377	2028/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	680	563	82,419	2031/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	500	450	65,815	2026/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	590	402	58,912	2051/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	280	242	35,446	2028/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	40	29	4,246	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	30	26	3,937	2026/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	390	350	51,311	2026/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	330	284	41,597	2028/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	580	501	73,275	2028/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	970	775	113,322	2031/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	650	554	81,051	2028/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	230	143	20,965	2051/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	210	138	20,323	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	70	62	9,107	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	30	28	4,179	2024/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	460	409	59,914	2026/08/31

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	100	94	13,878	2024/09/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	40	34	5,008	2028/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	540	482	70,498	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	470	283	41,448	2051/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,040	833	121,892	2031/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	100	94	13,834	2024/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	650	582	85,245	2026/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	420	377	55,174	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	260	223	32,703	2028/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	170	117	17,142	2041/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	1,210	1,144	167,409	2024/12/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	380	328	48,036	2028/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	530	475	69,525	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	60	51	7,521	2028/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	950	789	115,462	2032/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	370	350	51,269	2025/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	540	471	68,895	2029/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	200	146	21,433	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	500	331	48,460	2052/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	550	482	70,559	2029/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	50	45	6,671	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	600	569	83,262	2025/03/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	290	260	38,159	2029/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	700	672	98,327	2025/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	40	37	5,451	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	400	369	54,028	2029/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	910	817	119,607	2032/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	890	855	125,096	2025/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	290	272	39,801	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	300	252	36,898	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	520	396	58,026	2052/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	420	404	59,089	2025/06/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	280	261	38,216	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	430	394	57,620	2029/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	610	587	85,935	2025/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	280	267	39,086	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	430	404	59,164	2029/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	100	88	12,979	2032/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	20	19	2,862	2024/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	350	327	47,900	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	430	407	59,652	2027/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	420	381	55,778	2029/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	430	367	53,764	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	160	125	18,332	2052/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	220	205	30,027	2029/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	350	344	50,423	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	150	145	21,322	2029/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	1,000	988	144,582	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	730	721	105,547	2032/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	400	396	57,977	2025/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	200	197	28,806	2027/10/31

## ヘッジ付き外国債券バッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	30	29	4,280	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	300	293	42,928	2029/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	440	427	62,537	2029/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	500	467	68,397	2042/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	380	360	52,735	2052/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	720	706	103,270	2025/12/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	1,200	1,183	173,105	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	1,250	1,230	179,967	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	320	312	45,762	2026/01/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	300	292	42,810	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	500	485	71,041	2029/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	470	451	66,046	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	950	942	137,754	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	500	490	71,721	2026/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	150	142	20,859	2030/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	220	201	29,509	2043/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	300	265	38,855	2053/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	650	636	93,037	2030/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	400	392	57,409	2028/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	470	460	67,359	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	100	99	14,563	2026/03/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	30	28	4,236	2028/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	210	201	29,405	2030/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	720	670	98,040	2033/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	700	685	100,290	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	330	325	47,564	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	30	29	4,261	2026/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	270	259	37,919	2028/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	400	386	56,509	2028/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	450	412	60,318	2043/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	250	221	32,413	2053/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	500	496	72,558	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	370	363	53,111	2028/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	600	592	86,659	2028/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	50	51	7,550	2036/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	40	40	5,915	2038/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	80	72	10,615	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	70	69	10,134	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	80	80	11,710	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	100	103	15,073	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	140	139	20,447	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	40	37	5,476	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	140	137	20,102	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	30	29	4,359	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	210	174	25,524	2041/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	150	124	18,152	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	230	178	26,030	2042/08/15
小	計		-	71,650	63,263	9,250,338	-
カ ナ ダ	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.0000	90	102	11,039	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	90	88	9,544	2045/12/01

## ヘッジ付き外国債券バッシュ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	期 末				
			利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	160	153	16,503	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	90	78	8,402	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	20	18	1,994	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	140	125	13,465	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	130	94	10,187	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	60	55	5,922	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	60	55	5,941	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	230	221	23,892	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	150	127	13,712	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	60	56	6,121	2025/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	180	165	17,826	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	170	134	14,521	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	70	62	6,780	2026/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	390	331	35,641	2031/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	250	168	18,145	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	160	144	15,551	2027/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	110	92	9,970	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	120	109	11,809	2029/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	70	61	6,567	2032/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	10	9	1,020	2027/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	50	48	5,202	2025/10/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	130	117	12,677	2032/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	220	214	23,121	2028/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	150	147	15,864	2025/05/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	270	260	28,004	2026/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	184	19,889	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	50	48	5,196	2028/09/01
	CANADA GOVERNMENT	国債証券	2.7500	50	41	4,486	2064/12/01
小	計		—	3,930	3,520	379,005	—
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7500	160	165	15,487	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	130	125	11,803	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	180	178	16,717	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2500	130	131	12,330	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	150	141	13,319	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	120	104	9,770	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	190	182	17,084	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	70	54	5,160	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	140	132	12,449	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	187	17,555	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	30	23	2,238	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	260	216	20,279	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	280	222	20,850	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	170	137	12,935	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	160	90	8,510	2051/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	200	184	17,336	2025/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	130	102	9,605	2031/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	150	135	12,736	2026/09/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	180	147	13,861	2032/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	140	127	11,922	2033/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	150	145	13,615	2034/05/21

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	期 末				
			利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	30	28	2,650	2034/12/21
小	計		—	3,350	2,965	278,221	—
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	千シンガポール・ドル 320	千シンガポール・ドル 312	33,743	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	110	111	11,998	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	210	206	22,245	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	160	156	16,890	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	120	114	12,291	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	193	20,815	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	250	224	24,232	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	140	136	14,744	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	130	117	12,632	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	60	47	5,110	2050/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	70	65	7,074	2025/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	30	23	2,561	2051/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	10	9	1,066	2072/08/01
小	計		—	1,810	1,719	185,408	—
ニュージーランド	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	千ニュージーランド・ドル 30	千ニュージーランド・ドル 28	2,485	2025/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	70	53	4,668	2037/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	1.7500	20	12	1,050	2041/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	0.2500	140	112	9,746	2028/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	30	19	1,680	2051/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	0.5000	120	106	9,175	2026/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.0000	200	158	13,702	2032/05/15
小	計		—	610	491	42,509	—
イギリス	UK GILT	国債証券	6.0000	千イギリス・ポンド 100	千イギリス・ポンド 106	19,657	2028/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	210	208	38,435	2032/06/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	180	175	32,303	2036/03/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	110	111	20,551	2038/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	80	78	14,512	2027/12/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	170	166	30,642	2042/12/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	110	112	20,735	2030/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	90	84	15,530	2049/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	130	124	22,870	2039/09/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	100	100	18,471	2034/09/07
	UK GILT	国債証券	4.0000	110	99	18,367	2060/01/22
	UK GILT	国債証券	3.7500	40	34	6,332	2052/07/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	180	146	26,909	2044/01/22
	UK GILT	国債証券	3.5000	140	114	21,113	2068/07/22
	UK GILT	国債証券	3.5000	120	100	18,534	2045/01/22
	UK GILT	国債証券	2.0000	110	103	19,079	2025/09/07
	UK GILT	国債証券	2.5000	120	76	13,997	2065/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	110	100	18,519	2026/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	110	60	11,084	2047/07/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	170	120	22,162	2037/09/07
	UK GILT	国債証券	1.7500	120	62	11,584	2057/07/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	170	149	27,595	2027/07/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	70	60	11,216	2028/10/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	130	59	11,043	2071/10/22

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	期 末				
			利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	UK GILT	国債証券	1.7500	110	62	11,572	2049/01/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	100	81	14,948	2029/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	130	120	22,192	2025/06/07
	UK GILT	国債証券	0.3750	70	52	9,756	2030/10/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	180	105	19,485	2041/10/22
	UK GILT	国債証券	0.5000	140	41	7,549	2061/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	80	31	5,720	2050/10/22
	UK GILT	国債証券	0.1250	240	215	39,587	2026/01/30
	UK GILT	国債証券	0.1250	50	41	7,589	2028/01/31
	UK GILT	国債証券	0.6250	190	122	22,574	2035/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	120	87	16,048	2031/07/31
	UK GILT	国債証券	0.3750	160	139	206,719	2026/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	220	105	19,341	2046/01/31
	UK GILT	国債証券	1.2500	200	95	17,523	2051/07/31
	UK GILT	国債証券	0.5000	120	96	17,830	2029/01/31
	UK GILT	国債証券	1.5000	20	9	1,839	2053/07/31
	UK GILT	国債証券	1.0000	250	190	35,132	2032/01/31
	UK GILT	国債証券	1.1250	90	32	5,968	2073/10/22
	UK GILT	国債証券	4.1250	60	58	10,781	2027/01/29
	UK GILT	国債証券	3.7500	40	36	6,676	2038/01/29
	UK GILT	国債証券	3.5000	360	347	63,971	2025/10/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	210	191	35,196	2033/01/31
	UK GILT	国債証券	3.7500	140	119	22,060	2053/10/22
	UK GILT	国債証券	4.5000	150	148	27,328	2028/06/07
	UK TSY GILT	国債証券	1.1250	40	24	4,539	2039/01/31
小	計		—	6,450	5,117	942,188	—
イスラエル	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.7500	150	142	5,503	2025/08/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	200	185	7,163	2047/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.0000	140	131	5,052	2027/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.2500	110	117	4,521	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.2500	180	166	6,424	2028/09/28
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.0000	210	175	6,762	2030/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	70	51	1,973	2037/05/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.5000	210	197	7,598	2025/04/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.5000	160	146	5,633	2026/02/27
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.3000	120	97	3,752	2032/04/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.8000	120	90	3,484	2052/11/29
小	計		—	1,670	1,500	57,872	—
デンマーク	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5000	790	957	20,289	2039/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.7500	620	602	12,767	2025/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	570	519	11,010	2027/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	510	446	9,463	2029/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.2500	410	205	4,357	2052/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.0000	40	32	681	2031/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.0000	160	153	3,261	2024/11/15
小	計		—	3,100	2,919	61,831	—
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	410	394	5,376	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	260	243	3,321	2026/02/19

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	期 末				
			利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	290	268	3,656	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	240	220	2,999	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	370	328	4,468	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.3750	180	152	2,082	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	390	320	4,362	2031/09/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	174	2,377	2032/05/18
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	200	186	2,539	2033/08/15
小	計		—	2,540	2,289	31,184	—
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	3.5000	290	313	4,165	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.2500	200	192	2,559	2032/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.5000	240	236	3,141	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.0000	730	683	9,084	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	410	371	4,943	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	710	628	8,352	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	380	310	4,131	2031/05/12
小	計		—	2,960	2,735	36,379	—
メキシコ	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	10.0000	1,350	1,336	11,617	2024/12/05
	MEX BONOS DE DESARROLLO	国債証券	7.5000	2,500	2,339	20,338	2027/06/03
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	3,070	2,969	25,813	2029/05/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	1,700	1,592	13,844	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	1,640	1,507	13,105	2031/05/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	1,400	1,207	10,495	2042/11/13
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	920	828	7,202	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.7500	3,640	3,307	28,754	2026/03/05
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	2,100	1,849	16,080	2047/11/07
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	1,200	1,164	10,119	2024/09/05
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.5000	2,200	1,929	16,773	2027/03/04
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.0000	500	463	4,026	2025/03/06
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.5000	2,300	2,050	17,824	2033/05/26
小	計		—	24,520	22,547	195,996	—
中 国	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	1,200	1,217	24,433	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	2,800	2,815	56,486	2024/09/02
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	3,900	3,997	80,209	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7200	4,000	4,624	92,794	2051/04/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0200	3,500	3,626	72,773	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	3,700	3,720	74,654	2027/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2400	1,000	1,002	20,118	2025/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	5,600	5,607	112,520	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	4,400	4,417	88,641	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	4,200	4,267	85,633	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	1,000	1,042	20,918	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	4,800	4,809	96,502	2025/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	2,800	2,844	57,082	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	2,600	2,628	52,743	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	1,400	1,408	28,257	2026/02/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,000	1,017	20,422	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	3,400	3,408	68,383	2026/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	1,200	1,213	24,342	2033/05/25

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	期 末				
			利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	800	852	17,097	2053/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	2,600	2,616	52,506	2030/06/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	1,400	1,403	28,160	2028/07/15
小	計		-	57,300	58,543	1,174,683	-
ポーランド	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	千ポーランド・ズロチ 50	千ポーランド・ズロチ 44	1,578	2028/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	240	216	7,641	2027/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	430	372	13,123	2029/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	310	299	10,545	2024/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	580	539	19,011	2025/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	500	378	13,354	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	111	3,929	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	300	284	10,030	2027/05/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	430	468	16,508	2028/07/25
小	計		-	2,990	2,714	95,722	-
ユ ー ロ			-	千ユーロ	千ユーロ		
アイルランド	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	5.4000	50	51	8,163	2025/03/13
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.4000	100	97	15,364	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.0000	90	85	13,516	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.7000	60	49	7,851	2037/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.9000	80	73	11,571	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3000	20	17	2,718	2033/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3500	60	53	8,514	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.1000	50	45	7,171	2029/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.5000	70	47	7,494	2050/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.2000	10	9	1,429	2027/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.2000	80	66	10,457	2030/10/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.0000	50	39	6,271	2031/10/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.3500	20	15	2,518	2032/10/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.0000	20	19	3,033	2043/10/18
IRISH GOVT	国債証券	0.5500	100	63	10,008	2041/04/22	
オランダ	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	4.0000	110	122	19,369	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	30	33	5,263	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	140	136	21,559	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.7500	80	78	12,335	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	140	132	20,989	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	70	65	10,337	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	60	55	8,772	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	150	136	21,533	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	150	129	20,502	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	310	212	33,566	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	120	99	15,717	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	180	163	25,861	2027/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	60	27	4,331	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	90	72	11,470	2031/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	70	45	7,250	2038/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	40	34	5,451	2029/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	100	93	14,729	2026/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	100	82	12,971	2032/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.0000	70	57	9,113	2054/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	30	29	4,611	2033/07/15



## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	期 末				
			利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ベルギー	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	100	111	17,547	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5000	100	103	16,349	2026/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	150	160	25,338	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	100	103	16,383	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	140	137	21,636	2034/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	250	239	37,848	2025/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9000	140	115	18,223	2038/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6000	100	69	10,956	2047/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	130	120	18,972	2027/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.5000	30	29	4,586	2024/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4500	10	7	1,247	2037/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	170	154	24,380	2028/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.2500	100	85	13,426	2033/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9000	160	143	22,618	2029/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.7000	10	6	1,082	2050/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.1000	50	41	6,523	2030/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.4000	140	85	13,538	2040/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	10	8	1,401	2027/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.6500	30	11	1,844	2071/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	10	7	1,236	2031/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.3500	220	173	27,447	2032/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4000	180	110	17,372	2053/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.7500	160	146	23,178	2039/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.4500	50	49	7,795	2043/06/22
フランス	FRANCE O. A. T.	国債証券	6.0000	180	190	30,118	2025/10/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.5000	340	385	60,870	2029/04/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.7500	140	170	26,908	2032/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.7500	100	115	18,169	2035/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	20	21	3,469	2055/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	210	227	35,898	2038/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.5000	350	402	63,556	2041/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	120	132	20,987	2060/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.5000	320	323	51,141	2026/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	470	467	73,802	2027/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.2500	280	272	43,077	2045/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	120	117	18,584	2024/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	320	312	49,394	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	300	286	45,269	2025/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	270	252	39,874	2026/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	20	15	2,510	2036/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	120	77	12,188	2066/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.2500	150	137	21,736	2026/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	360	292	46,251	2039/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	70	65	10,311	2027/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	390	353	55,839	2028/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	110	91	14,424	2034/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	350	314	49,641	2028/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	290	193	30,541	2050/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	200	175	27,669	2029/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	360	342	54,087	2025/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	330	276	43,658	2029/11/25

## ヘッジ付き外国債券バッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	230	119	18,843	2052/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	500	464	73,299	2026/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	560	455	71,880	2030/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	380	242	38,254	2040/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	80	28	4,555	2072/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	150	86	13,676	2044/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	340	267	42,268	2031/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	470	424	67,088	2027/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	260	247	39,135	2025/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	310	240	37,888	2032/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	240	182	28,810	2038/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	60	54	8,633	2028/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	630	579	91,449	2032/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	120	104	16,463	2043/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	310	305	48,231	2026/09/24
	FRANCE OAT.	国債証券	3.0000	40	36	5,733	2054/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	150	148	23,504	2029/02/25
	FRANCE O. A. T.	国債証券	0.7500	30	15	2,397	2053/05/25
ド イ ツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.5000	160	182	28,789	2027/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.6250	160	180	28,453	2028/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	170	187	29,570	2028/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	130	158	25,056	2030/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.0000	260	299	47,290	2037/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.2500	160	192	30,364	2039/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	160	204	32,337	2040/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	350	341	53,970	2044/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	200	195	30,920	2046/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	200	192	30,411	2025/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	10	9	1,545	2024/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	20	19	3,039	2025/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	100	94	14,924	2026/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	220	203	32,093	2026/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	20	18	2,912	2027/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.2500	30	22	3,583	2048/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	100	91	14,459	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	150	134	21,232	2028/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	280	248	39,251	2029/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	250	216	34,138	2029/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	100	50	7,982	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	160	136	21,603	2030/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	260	192	30,460	2035/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	170	143	22,689	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	220	197	31,248	2027/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	110	93	14,702	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	240	200	31,649	2031/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	30	21	3,412	2036/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	130	66	10,434	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	10	8	1,389	2028/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	180	148	23,450	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	100	82	13,044	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	140	67	10,622	2052/08/15

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	250	203	32,150	2032/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	190	151	23,993	2038/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7000	280	262	41,499	2032/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.1000	130	127	20,059	2029/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.8000	270	224	35,409	2053/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.3000	90	88	13,973	2033/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.3000	90	88	13,987	2033/02/15
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	2.2000	100	98	15,586	2024/12/12
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	2.5000	470	465	73,511	2025/03/13
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	国債証券	2.8000	200	199	31,441	2025/06/12
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	70	67	10,654	2024/10/18
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	360	342	54,121	2025/04/11
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	100	94	14,848	2025/10/10
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	110	103	16,360	2025/10/10
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	110	102	16,158	2026/04/10
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	220	202	31,955	2026/10/09
	BUNDES OblIGATION	国債証券	0.0000	240	218	34,498	2027/04/16
	BUNDES OblIGATION	国債証券	1.3000	90	85	13,512	2027/10/15
	BUNDES OblIGATION	国債証券	1.3000	70	66	10,534	2027/10/15
	BUNDES OblIGATION	国債証券	2.2000	160	157	24,888	2028/04/13
スペイン	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	6.0000	210	238	37,703	2029/01/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.2000	290	192	30,441	2040/10/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	5.7500	70	82	13,024	2032/07/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	4.2000	200	209	33,109	2037/01/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	4.7000	100	110	17,396	2041/07/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	4.6500	140	143	22,653	2025/07/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	5.9000	60	64	10,161	2026/07/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	80	93	14,765	2044/10/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	2.7500	80	79	12,522	2024/10/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.6000	200	194	30,692	2025/04/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	260	238	37,678	2030/07/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	230	222	35,132	2026/04/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	130	113	17,972	2066/07/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.5000	190	179	28,262	2027/04/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	2.3500	100	90	14,299	2033/07/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	180	167	26,511	2027/10/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	190	175	27,704	2028/04/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	240	220	34,840	2028/07/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	320	290	45,932	2029/04/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.8500	20	16	2,619	2035/07/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	0.6000	100	85	13,482	2029/10/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	140	117	18,478	2030/04/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	240	219	34,603	2027/07/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	40	20	3,242	2050/10/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	70	66	10,532	2025/01/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.2500	180	156	24,724	2030/10/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	300	277	43,814	2026/01/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	0.1000	100	78	12,374	2031/04/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	70	32	5,107	2071/10/31
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	0.8500	190	130	20,592	2037/07/30
	BONOS Y OblIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	200	159	25,171	2031/10/31

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	300	184	29,070	2042/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	210	188	29,744	2027/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.7000	60	47	7,573	2032/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	210	198	31,287	2025/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9000	20	12	2,011	2052/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	10	8	1,372	2029/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.5500	110	102	16,156	2032/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	50	46	7,303	2043/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.8000	150	148	23,383	2026/05/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.1500	250	243	38,360	2033/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.9000	280	280	44,238	2039/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.5500	20	20	3,158	2033/10/31
イタリア	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.5000	190	211	33,392	2027/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	200	210	33,157	2028/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	40	34	5,430	2030/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	90	59	9,416	2037/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.2500	250	271	42,810	2029/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.0000	250	285	45,126	2031/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.7500	240	271	42,881	2033/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	250	267	42,184	2034/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	220	234	37,045	2039/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	250	255	40,260	2025/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	180	192	30,349	2040/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	130	132	20,994	2026/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.7500	10	10	1,579	2024/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	130	128	20,253	2024/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	140	116	18,358	2046/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	130	125	19,799	2025/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	20	16	2,639	2032/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	220	212	33,597	2025/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6000	180	170	26,979	2026/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.7000	150	112	17,825	2047/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2500	170	135	21,459	2036/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.2500	20	18	2,936	2026/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	90	61	9,778	2067/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	10	8	1,347	2048/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0500	280	264	41,771	2027/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	20	19	3,076	2024/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.9500	200	169	26,718	2038/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	190	177	28,046	2028/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	20	19	3,028	2028/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	20	19	3,091	2025/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.3500	20	18	2,900	2035/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	10	9	1,429	2049/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.0000	200	192	30,355	2029/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1000	150	144	22,755	2026/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.1000	270	228	36,105	2040/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.3500	170	145	23,035	2030/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.3500	230	219	34,683	2025/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.8500	230	210	33,218	2027/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	160	132	20,856	2030/08/01

## ヘッジ付き外国債券バッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	20	14	2,303	2036/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	50	34	5,461	2050/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	210	189	29,907	2027/09/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	360	334	52,854	2026/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8000	60	41	6,496	2041/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9000	210	169	26,688	2031/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.6000	100	77	12,256	2031/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	60	54	8,647	2026/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.2500	130	111	17,656	2028/03/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	130	78	12,345	2045/04/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1500	50	28	4,487	2072/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	80	68	10,868	2028/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	100	79	12,493	2031/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	10	9	1,424	2026/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.4500	20	16	2,653	2029/02/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	120	93	14,748	2032/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	330	315	49,732	2024/12/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1500	100	63	9,977	2052/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.1000	180	165	26,088	2027/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	320	304	48,044	2029/06/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	20	17	2,788	2032/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	170	149	23,580	2038/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.6500	50	48	7,598	2027/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	120	117	18,550	2035/04/30
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	80	79	12,619	2026/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	100	100	15,826	2029/12/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.4000	200	205	32,377	2033/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4000	100	98	15,626	2028/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.4500	130	129	20,378	2043/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	70	69	10,901	2053/10/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4000	80	79	12,582	2025/03/28
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8000	150	150	23,818	2026/04/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	120	120	19,042	2031/10/30
	BTPS	国債証券	0.0000	70	67	10,674	2024/08/15
フィンランド	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.6250	10	9	1,443	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	60	50	8,048	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	70	65	10,380	2026/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.3750	10	7	1,110	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.1250	100	82	12,963	2034/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	60	53	8,409	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	50	43	6,841	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	60	57	9,142	2024/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	40	27	4,305	2036/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.2500	30	18	2,878	2040/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	50	40	6,417	2030/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	60	26	4,188	2052/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.1250	40	31	5,028	2031/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.0000	100	91	14,438	2026/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	30	18	2,856	2043/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.5000	20	17	2,776	2032/09/15

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	6.2500	80	89	14,127	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.1500	90	98	15,545	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.8500	150	156	24,731	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.8000	30	33	5,270	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	50	49	7,745	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	150	140	22,165	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	40	36	5,788	2027/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	80	72	11,489	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	110	96	15,241	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	70	57	9,125	2030/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	20	11	1,784	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	190	109	17,261	2040/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	100	80	12,631	2031/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7000	70	29	4,666	2071/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	90	85	13,492	2025/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.2500	100	68	10,795	2036/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	80	68	10,865	2028/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.9000	100	83	13,257	2032/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.8500	80	60	9,584	2049/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.9000	40	39	6,201	2033/02/20
小 計			—	44,160	40,006	6,315,446	—
合 計			—	—	—	19,046,789	—

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

## ■ 投資信託財産の構成

(2023年8月25日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 19,046,789	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	489,657	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	19,536,447	100.0

※期末における外貨建資産（19,262,551千円）の投資信託財産総額（19,536,447千円）に対する比率は98.6%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=146.22円、1カナダ・ドル=107.66円、1オーストラリア・ドル=93.83円、1シンガポール・ドル=107.82円、1ニュージーランド・ドル=86.56円、1イギリス・ポンド=184.12円、1イスラエル・シェケル=38.559円、1デンマーク・クローネ=21.18円、1ノルウェー・クローネ=13.62円、1スウェーデン・クローナ=13.30円、1メキシコ・ペソ=8.692円、1オフショア・人民元=20.065円、1ポーランド・ズロチ=35.261円、1ユーロ=157.86円です。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年8月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	54,399,685,332円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,120,039
公 社 債 ( 評 価 額 )	19,046,789,782
未 収 入 金	35,207,020,438
未 収 利 息	116,505,202
前 払 費 用	22,249,871
(B) 負 債	35,424,156,045
未 払 金	35,424,154,942
そ の 他 未 払 費 用	1,103
(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )	18,975,529,287
元 本	15,557,816,902
次 期 繰 越 損 益 金	3,417,712,385
(D) 受 益 権 総 口 数	15,557,816,902口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 ( C / D )	12,197円

※当期における期首元本額20,045,973,704円、期中追加設定元本額10,145,485,979円、期中一部解約元本額14,633,642,781円です。  
 ※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。  
 アセットアロケーション・ファンド(安定型) 1,760,270,556円  
 アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) 592,185,183円  
 アセットアロケーション・ファンド(成長型) 11,933,989円  
 イオン・バランス戦略ファンド 860,888,225円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) 1,352,013,527円  
 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) 586,893,997円  
 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) 1,157,922,769円  
 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) 322,296,314円  
 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) 52,630,230円  
 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド 85,264,726円  
 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり) 620,558,216円  
 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型) 2,955,830円  
 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型) 8,342,181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) 27,656,256円  
 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型) 7,573,209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) 1,011,778円  
 SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> 1,095,387,104円  
 SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> 1,006,607円  
 SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンドII<適格機関投資家限定> 5,409,378,599円  
 SMAM・年金Wリスコントロールファンド<適格機関投資家限定> 577,171,078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> 356,698,167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> 570,510,470円  
 三井住友・ニュー・アジア・ファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定> 97,267,891円

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

### ■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

### ■ 損益の状況

(自2022年8月26日 至2023年8月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	562,389,868円
受 取 利 息	562,501,773
そ の 他 収 益 金	775
支 払 利 息	△ 112,680
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,619,752,740
売 買 損 益	6,033,025,711
売 買 損 益	△8,652,778,451
(C) そ の 他 費 用 等	△ 18,158,708
(D) 当 期 損 益 金 ( A + B + C )	△2,075,521,580
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	6,446,821,663
(F) 解 約 差 損 益 金	△3,596,705,760
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,643,118,062
(H) 合 計 ( D + E + F + G )	3,417,712,385
次 期 繰 越 損 益 金 ( H )	3,417,712,385

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

# 外国債券パッシブ・マザーファンド

第19期（2021年12月18日から2022年12月19日まで）

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

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

## ■ 最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		(ベンチマーク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		公 社 債 率 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
15期（2018年12月17日）	円	%		%	%	百万円
15期（2018年12月17日）	17,553	△1.9	177.36	△2.0	98.7	168,894
16期（2019年12月17日）	18,248	4.0	184.64	4.1	98.6	171,892
17期（2020年12月17日）	19,109	4.7	193.48	4.8	99.0	161,689
18期（2021年12月17日）	19,947	4.4	201.87	4.3	99.1	162,393
19期（2022年12月19日）	19,845	△0.5	200.98	△0.4	98.9	154,701

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

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



■ 当期中の基準価額と市況等の推移

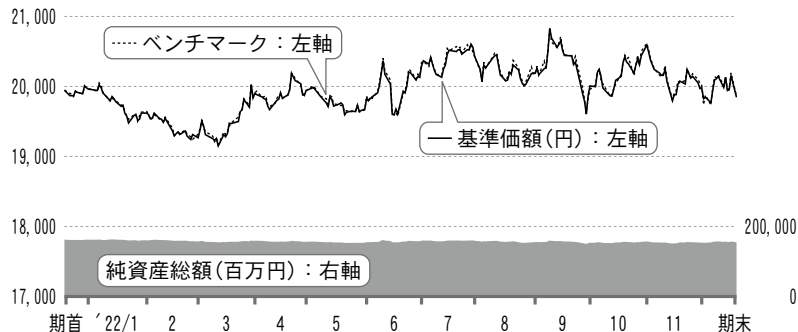
年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		公 社 債 組 入 比 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
(期 首) 2021年12月17日	円 19,947	% —	201.87	% —	% 99.1
12月末	19,962	0.1	202.11	0.1	98.8
2022年1月末	19,620	△1.6	198.79	△1.5	99.2
2月末	19,267	△3.4	195.51	△3.1	99.2
3月末	19,901	△0.2	201.52	△0.2	98.9
4月末	19,943	△0.0	201.80	△0.0	98.8
5月末	19,824	△0.6	201.02	△0.4	98.5
6月末	20,294	1.7	205.87	2.0	98.7
7月末	20,430	2.4	206.71	2.4	99.0
8月末	20,188	1.2	204.09	1.1	98.4
9月末	20,008	0.3	201.99	0.1	98.5
10月末	20,591	3.2	208.63	3.3	98.5
11月末	19,980	0.2	202.57	0.3	98.4
(期 末) 2022年12月19日	円 19,845	% △0.5	200.98	% △0.4	% 98.9

※騰落率は期首比です。

## 1 運用経過

### ▶ 基準価額等の推移について（2021年12月18日から2022年12月19日まで）

#### 基準価額等の推移



期首	19,947円
期末	19,845円
騰落率	-0.5%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

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

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

### ▶ 基準価額の主な変動要因（2021年12月18日から2022年12月19日まで）

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

上昇要因	・米ドルを中心に投資通貨が対円で上昇したこと
下落要因	・欧米金利が上昇（債券価格は下落）したこと

---

▶ **投資環境について（2021年12月18日から2022年12月19日まで）**

---

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

**債券市場**

インフレ率上昇への懸念から、グローバルに中央銀行の急速な金融緩和策の縮小が警戒され、欧米の金利は上昇しました。

**為替市場**

グローバルに中央銀行の金融緩和策の縮小が意識される中、欧米での金利先高観から米ドルを中心に投資通貨が対円で上昇しました。

---

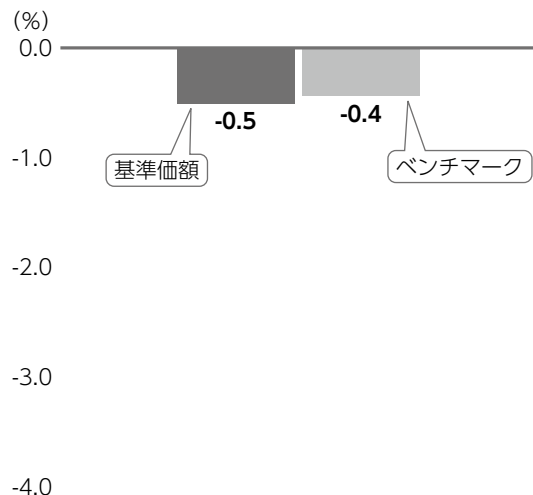
▶ **ポートフォリオについて（2021年12月18日から2022年12月19日まで）**

---

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

▶ ベンチマークとの差異について (2021年12月18日から2022年12月19日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は-0.5%となり、ベンチマークの騰落率-0.4%から0.1%の下方乖離となりました。

下方乖離要因 ・ キャッシュフローに伴う売買のタイミング

## 2 今後の運用方針

先進国では依然として粘着的なインフレ圧力が残るとみられるものの、米国等ではインフレのピークアウトの兆しも見え始めています。また、これまでの利上げに伴う景気減速が見込まれる中、FRB（米連邦準備制度理事会）の利上げペース鈍化などを受け、グローバルに中銀のタカ派（インフレ抑制を重視する立場）姿勢が緩むことで、先進国金利の上昇圧力は後退していくと予想します。

為替市場は、先進国金利の上昇圧力後退や日本銀行の政策調整観測などが円高要因になるとみられ、投資通貨は円に対して軟調な推移になりやすいと予想します。

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

### ■ 1万口当たりの費用明細 (2021年12月18日から2022年12月19日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	8円 (8)	0.038% (0.038)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	8	0.038	

期中の平均基準価額は19,956円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

外国債券パッシブ・マザーファンド

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年12月18日から2022年12月19日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 195,896	千アメリカ・ドル 212,347
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 9,186	千カナダ・ドル 9,482
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 5,492	千オーストラリア・ドル 6,819
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 2,968	千シンガポール・ドル 3,782
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 3,849	千ニュージーランド・ドル -
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 11,753	千イギリス・ポンド 14,882
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シェケル 4,973	千イスラエル・シェケル 9,620
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 2,244	千デンマーク・クローネ 8,498
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 3,232	千ノルウェー・クローネ 8,941
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 1,560	千スウェーデン・クローナ 11,104
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 14,892	千メキシコ・ペソ 26,213
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 256,265	千オフショア・人民元 14,165
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 6,025	千マレーシア・リンギット 6,684
	国	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 23,663
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ
アイルランド		国債証券	619	2,491
	オランダ	国債証券	2,618	4,749

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

			買 付 額	売 付 額
外	ベルギー	国債証券	3,273	4,661
	フランス	国債証券	17,541	27,291
	ドイツ	国債証券	15,329	19,965
	スペイン	国債証券	10,693	17,735
	イタリア	国債証券	15,543	25,918
国	フィンランド	国債証券	1,130	1,860
	オーストリア	国債証券	3,250	4,562

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2021年12月18日から2022年12月19日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

### ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年12月18日から2022年12月19日まで)

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

### ■ 組入れ資産の明細 (2022年12月19日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 631,120	千アメリカ・ドル 571,823	千円 77,893,780	% 50.4	% -	% 22.3	% 18.1	% 9.9
カナダ	千カナダ・ドル 32,550	千カナダ・ドル 31,410	3,129,436	2.0	-	1.2	0.5	0.3
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 28,550	千オーストラリア・ドル 26,906	2,455,718	1.6	-	1.1	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,300	千シンガポール・ドル 7,150	718,177	0.5	-	0.3	0.1	0.1

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ニュージーランド	千ニュージーランド・ ドル 4,300	千ニュージーランド・ ドル 3,819	332,288	0.2	—	0.1	0.1	—
イギリス	千イギリス・ポンド 47,550	千イギリス・ポンド 43,694	7,245,490	4.7	—	3.4	1.1	0.2
イスラエル	千イスラエル・シェケル 14,100	千イスラエル・シェケル 14,034	552,495	0.4	—	0.1	0.2	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 26,100	千デンマーク・クローネ 26,786	519,663	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 24,100	千ノルウェー・クローネ 22,792	314,312	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 23,200	千スウェーデン・クローナ 23,359	306,480	0.2	—	0.1	0.1	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 190,000	千メキシコ・ペソ 182,214	1,254,820	0.8	—	0.4	0.1	0.2
中 国	千オフショア・人民元 278,000	千オフショア・人民元 280,516	5,476,180	3.5	—	1.7	1.5	0.3
マレーシア	千マレーシア・リンギット 26,300	千マレーシア・リンギット 26,653	820,533	0.5	—	0.3	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 26,800	千ポーランド・ズロチ 21,531	663,275	0.4	—	0.1	0.1	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
アイルランド	7,200	6,601	952,855	0.6	—	0.4	0.2	0.0
オランダ	17,800	17,092	2,467,283	1.6	—	1.1	0.4	0.1
ベルギー	21,550	20,136	2,906,640	1.9	—	1.4	0.3	0.2
フランス	97,520	90,586	13,076,191	8.5	—	5.1	2.5	0.9
ドイツ	75,200	71,219	10,280,487	6.6	—	3.7	2.1	0.9
スペイン	55,200	53,060	7,659,238	5.0	—	3.0	1.3	0.7
イタリア	84,770	79,202	11,432,812	7.4	—	4.2	2.2	1.0
フィンランド	5,700	5,191	749,419	0.5	—	0.3	0.1	0.1
オーストリア	13,200	12,298	1,775,312	1.1	—	0.7	0.4	0.1
合 計	—	—	152,982,896	98.9	—	51.3	32.3	15.3

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。



外国債券パッシブ・マザーファンド

B 個別銘柄開示  
外国（外貨建）公社債

区 分	銘 柄	種 類	期				末	
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
ア メ リ カ	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,300	2,088	284,519	2043/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,400	2,089	284,616	2043/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	2,400	2,348	319,902	2043/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	700	697	95,010	2043/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	5,700	5,546	755,582	2024/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	5,100	4,996	680,660	2024/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	500	469	63,996	2044/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	5,600	5,421	738,512	2024/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.6250	600	586	79,921	2044/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,300	2,074	282,586	2044/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	5,100	4,919	670,080	2024/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,500	3,347	455,944	2025/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,500	3,091	421,083	2044/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,600	2,911	396,565	2045/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	600	573	78,098	2025/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,000	2,648	360,830	2045/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,300	3,134	427,013	2025/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,300	2,847	387,819	2045/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,000	3,817	520,060	2025/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,700	2,382	324,578	2045/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	2,900	2,710	369,281	2026/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	2,900	2,334	318,033	2046/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	14,950	13,896	1,892,977	2026/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,600	2,895	394,378	2046/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,450	1,872	255,046	2046/08/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	5,000	4,681	637,652	2026/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	3,100	3,029	412,713	2023/11/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,300	1,983	270,201	2046/11/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,000	2,929	399,113	2023/12/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,149	565,299	2027/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	2,200	2,145	292,212	2024/01/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,500	2,201	299,949	2047/02/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	6,500	6,307	859,141	2024/03/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,000	1,933	263,392	2024/04/30	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,000	1,944	264,830	2024/02/29	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	3,000	2,836	386,371	2027/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,800	1,585	215,963	2047/05/15	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,300	3,186	434,017	2024/05/31	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	4,100	3,952	538,384	2024/06/30	

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	3,500	3,376	460,006	2024/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,200	3,946	537,550	2027/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,300	2,781	378,900	2047/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	3,800	3,648	496,930	2024/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	4,000	3,853	524,910	2024/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	800	771	105,131	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,500	1,265	172,370	2047/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	4,400	4,121	561,457	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	2,600	2,500	340,681	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,900	3,756	511,707	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,400	3,287	447,803	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,800	4,596	626,067	2028/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,400	2,123	289,252	2048/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	1,943	264,798	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,000	969	132,047	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	400	389	53,082	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	9,000	8,654	1,178,951	2028/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,400	2,172	295,997	2048/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,100	3,015	410,800	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	900	873	118,976	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	4,500	4,321	588,684	2028/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	900	797	108,690	2048/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,400	3,291	448,308	2025/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	1,000	975	132,814	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,600	2,533	345,080	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	2,900	2,818	383,909	2028/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	3,100	2,949	401,826	2048/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,000	1,969	268,266	2023/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,900	1,862	253,750	2023/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,500	2,426	330,517	2025/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,400	1,350	183,995	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	2,700	2,603	354,590	2026/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,800	1,700	231,670	2029/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	3,300	2,941	400,640	2049/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	3,700	3,607	491,448	2024/02/29
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	2,100	2,013	274,316	2026/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	13,300	12,658	1,724,310	2026/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,800	3,686	502,122	2024/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,400	2,231	304,003	2029/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,400	1,220	166,228	2049/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	6,200	5,957	811,566	2024/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	850	814	111,018	2024/07/31

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	450	399	54,440	2029/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,500	2,679	365,024	2049/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	7,100	6,516	887,670	2026/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	3,000	2,859	389,518	2024/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,900	3,610	491,764	2026/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	5,500	5,235	713,210	2024/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,300	1,163	158,435	2029/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,900	1,494	203,596	2049/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	200	184	25,153	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	800	760	103,560	2024/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	2,100	1,836	250,169	2030/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,800	2,020	275,271	2050/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,000	1,802	245,482	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,600	1,478	201,333	2025/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	2,400	2,107	287,042	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	3,500	3,244	441,980	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	4,400	4,027	548,607	2027/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	1,500	1,407	191,765	2025/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	1,900	1,794	244,440	2025/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	4,000	3,815	519,717	2024/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,500	6,107	832,001	2030/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	5,100	3,020	411,456	2050/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	4,400	4,016	547,157	2025/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,000	1,332	181,513	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	2,500	2,174	296,264	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,754	375,231	2025/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,200	1,047	142,622	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,900	2,644	360,175	2025/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	4,000	3,472	473,043	2027/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	300	272	37,117	2025/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,500	2,154	293,441	2027/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,000	5,671	772,586	2030/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	4,500	2,753	375,021	2050/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,200	2,117	288,511	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	2,000	1,810	246,599	2025/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	4,800	4,113	560,374	2027/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	7,000	5,762	785,030	2030/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	3,200	2,093	285,142	2050/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	8,500	7,136	972,066	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	5,800	4,041	550,580	2051/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	5,900	5,113	696,540	2028/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	2,000	1,804	245,759	2025/11/30

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,704	368,398	2025/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	2,100	1,814	247,174	2027/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	7,200	6,209	845,886	2027/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,000	1,383	188,471	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	2,800	2,103	286,565	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	1,000	860	117,222	2027/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.2500	1,000	901	122,852	2025/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.1250	7,700	7,320	997,225	2024/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.6250	5,500	4,767	649,407	2031/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	1,400	1,097	149,436	2051/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	3,000	2,392	325,873	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	3,000	2,644	360,176	2028/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	5,200	4,345	591,906	2031/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	3,500	3,050	415,605	2028/08/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	2,900	2,080	283,439	2051/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	2,900	2,109	287,417	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	3,600	3,216	438,170	2026/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	5,900	5,115	696,830	2028/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	0.3750	3,000	2,804	382,048	2024/09/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,500	3,943	537,248	2028/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.6250	4,400	4,124	561,811	2024/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	1,300	903	123,046	2051/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	4,900	4,117	560,888	2031/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	0.7500	5,200	4,871	663,654	2024/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	4,200	3,816	519,917	2026/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	6,000	5,292	720,933	2028/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	3,800	2,880	392,430	2041/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.0000	4,500	4,230	576,210	2024/12/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	2,300	2,040	277,958	2028/11/30
	US TREASURY N/B	国債証券	0.8750	2,000	1,920	261,667	2024/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	2,000	1,880	256,178	2025/01/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.2500	2,300	2,087	284,347	2026/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	2,500	2,201	299,936	2028/12/31
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	5,300	4,636	631,546	2032/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.5000	3,000	2,838	386,612	2025/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	4,300	3,860	525,865	2029/01/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	2,800	2,263	308,290	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.2500	1,700	1,293	176,202	2052/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	2,800	2,533	345,120	2029/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	3,400	3,157	430,111	2027/02/28
	US TREASURY N/B	国債証券	1.7500	1,500	1,425	194,232	2025/03/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.3750	5,000	4,651	633,634	2029/03/31

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	4,500	4,358	593,686	2025/04/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	3,000	2,857	389,215	2027/03/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	3,500	3,352	456,636	2029/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	5,700	5,422	738,718	2032/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	3,000	2,912	396,796	2025/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,700	2,596	353,725	2027/04/30
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	1,000	929	126,662	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	1,700	1,483	202,120	2052/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	2,000	1,946	265,212	2025/06/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	4,800	4,593	625,733	2027/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	1,400	1,330	181,298	2029/05/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	2,000	1,951	265,808	2025/07/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.2500	3,000	2,936	400,020	2029/06/30
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	4,200	3,950	538,082	2032/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	3,000	2,935	399,910	2025/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.6250	1,100	1,037	141,312	2029/07/31
	US TREASURY N/B	国債証券	3.3750	3,000	2,840	386,866	2042/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	2,000	2,015	274,545	2025/10/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	3,500	3,558	484,755	2029/09/30
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	2,900	3,055	416,208	2032/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	3,800	3,857	525,519	2025/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.1250	3,500	3,572	486,677	2027/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	1,000	1,025	139,625	2029/10/31
	US TREASURY N/B	国債証券	4.0000	1,200	1,303	177,523	2052/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	6.0000	1,000	1,062	144,775	2026/02/15
	US TREASURY BOND	国債証券	6.1250	1,000	1,109	151,129	2027/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	5.2500	500	541	73,701	2028/11/15
	US TREASURY BOND	国債証券	5.3750	320	361	49,219	2031/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.5000	200	198	27,052	2039/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	100	108	14,800	2039/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.5000	300	335	45,715	2039/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	300	330	45,019	2039/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.6250	200	226	30,887	2040/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	900	989	134,732	2040/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.8750	500	515	70,211	2040/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.2500	600	648	88,314	2040/11/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.7500	900	1,034	140,882	2041/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	4.3750	300	329	44,821	2041/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.7500	1,500	1,509	205,607	2041/08/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.1250	1,000	915	124,736	2042/02/15
	US TREASURY N/B	国債証券	3.0000	800	715	97,498	2042/05/15
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	2,000	1,711	233,167	2042/08/15

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	300	256	34,924	2042/11/15
小 計			-	631,120	571,823	77,893,780	-
カ ナ ダ	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	千カナダ・ドル 250	千カナダ・ドル 294	29,291	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7500	400	504	50,244	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	5.0000	600	743	74,052	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0000	1,900	2,179	217,163	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5000	1,200	1,315	131,030	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	2,100	2,062	205,492	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	500	486	48,517	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,300	1,267	126,235	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	3,200	3,035	302,441	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.0000	1,100	1,016	101,293	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	700	674	67,157	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,400	1,361	135,605	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,000	980	97,697	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,200	2,122	211,457	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.2500	5,700	5,123	510,488	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	2,700	2,500	249,143	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,000	773	77,017	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	2,300	2,065	205,784	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	700	669	66,676	2025/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,600	1,553	154,812	2029/12/01
CANADA GOVERNMENT	国債証券	2.7500	700	680	67,830	2064/12/01	
小 計			-	32,550	31,410	3,129,436	-
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	千オーストラリア・ドル 2,500	千オーストラリア・ドル 2,486	226,967	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	800	797	72,775	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5000	900	981	89,545	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	1,300	1,303	119,010	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2500	2,150	2,222	202,888	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7500	1,200	1,207	110,246	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	800	731	66,784	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,300	1,271	116,083	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2500	2,000	1,874	171,094	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	1,600	1,520	138,782	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	1,200	1,042	95,163	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	194	17,736	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,800	1,734	158,315	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.5000	2,600	2,452	223,835	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	4,700	4,037	368,544	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	323	29,536	2051/06/21

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	800	736	67,181	2025/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	1,200	1,029	93,960	2032/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	1,000	956	87,264	2033/11/21
	小 計		—	28,550	26,906	2,455,718	—
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 1,100	千シンガポール・ドル 1,128	113,378	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	1,000	997	100,205	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	200	198	19,957	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	700	698	70,149	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	300	311	31,322	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	800	818	82,200	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	800	737	74,122	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	788	79,178	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	1,000	904	90,875	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	600	565	56,786	2026/11/01
	小 計		—	7,300	7,150	718,177	—
ニュージーランド	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	4.5000	千ニュージーランド・ドル 1,100	千ニュージーランド・ドル 1,101	95,865	2027/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,100	1,050	91,355	2025/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	3.0000	600	556	48,410	2029/04/20
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	329	28,649	2041/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.7500	500	368	32,051	2051/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	2.0000	500	413	35,956	2032/05/15
	小 計		—	4,300	3,819	332,288	—
イギリス	UK GILT	国債証券	6.0000	千イギリス・ポンド 650	千イギリス・ポンド 741	122,873	2028/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	500	536	88,984	2032/06/07
	UK GILT	国債証券	5.0000	1,300	1,343	222,852	2025/03/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	962	159,589	2036/03/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	1,000	1,125	186,565	2038/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,700	1,895	314,354	2055/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	1,500	1,608	266,690	2046/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	937	155,417	2027/12/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	1,050	1,156	191,809	2042/12/07
	UK GILT	国債証券	4.7500	1,150	1,268	210,267	2030/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	900	973	161,429	2049/12/07
	UK GILT	国債証券	4.2500	600	636	105,578	2039/09/07
	UK GILT	国債証券	4.5000	1,100	1,204	199,662	2034/09/07
	UK GILT	国債証券	4.0000	1,300	1,415	234,738	2060/01/22
	UK GILT	国債証券	4.2500	600	636	105,625	2040/12/07
	UK GILT	国債証券	3.7500	1,200	1,209	200,510	2052/07/22
	UK GILT	国債証券	3.2500	1,600	1,475	244,644	2044/01/22

外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	UK GILT	国債証券	3.5000	1,300	1,301	215,889	2068/07/22
	UK GILT	国債証券	2.7500	900	887	147,191	2024/09/07
	UK GILT	国債証券	3.5000	1,250	1,195	198,246	2045/01/22
	UK GILT	国債証券	2.0000	1,100	1,061	176,014	2025/09/07
	UK GILT	国債証券	2.5000	1,600	1,255	208,230	2065/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	1,100	1,032	171,140	2026/07/22
	UK GILT	国債証券	1.5000	2,000	1,280	212,359	2047/07/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	100	78	12,977	2037/09/07
	UK GILT	国債証券	1.2500	200	182	30,273	2027/07/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	300	274	45,510	2028/10/22
	UK GILT	国債証券	1.0000	800	774	128,399	2024/04/22
	UK GILT	国債証券	1.7500	1,250	840	139,386	2049/01/22
	UK GILT	国債証券	1.6250	500	311	51,570	2054/10/22
	UK GILT	国債証券	0.8750	500	427	70,874	2029/10/22
	UK GILT	国債証券	0.6250	2,900	2,716	450,476	2025/06/07
	UK GILT	国債証券	0.3750	1,800	1,439	238,646	2030/10/22
	UK GILT	国債証券	0.5000	100	38	6,306	2061/10/22
	UK GILT	国債証券	0.1250	1,300	1,181	195,919	2026/01/30
	UK GILT	国債証券	0.1250	500	425	70,593	2028/01/31
	UK GILT	国債証券	0.6250	2,200	1,540	255,516	2035/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	1,300	998	165,640	2031/07/31
	UK GILT	国債証券	0.3750	1,200	1,072	177,849	2026/10/22
	UK GILT	国債証券	1.2500	500	285	47,363	2051/07/31
	UK GILT	国債証券	0.2500	700	651	108,100	2025/01/31
	UK GILT	国債証券	0.5000	1,800	1,517	251,701	2029/01/31
	UK GILT	国債証券	1.0000	1,700	1,381	228,999	2032/01/31
	UK GILT	国債証券	1.1250	300	139	23,094	2073/10/22
	UK TSY GILT	国債証券	1.1250	400	275	45,623	2039/01/31
	小 計		—	47,550	43,694	7,245,490	—
イスラエル	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.7500	千イスラエル・シケル 3,500	千イスラエル・シケル 3,645	143,529	2047/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.5000	2,200	2,162	85,129	2023/11/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.2500	2,600	2,863	112,727	2026/10/30
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.2500	500	471	18,566	2028/09/28
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.0000	700	597	23,518	2030/03/31
	ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.5000	4,600	4,293	169,023	2025/04/30
	小 計		—	14,100	14,034	552,495	—
デンマーク	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 8,700	千デンマーク・クローネ 11,404	221,250	2039/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.7500	2,800	2,744	53,250	2025/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	8,000	7,304	141,700	2027/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	4,800	4,229	82,051	2029/11/15



## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末					
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.2500	1,800	1,103	21,410	2052/11/15	
小 計			-	26,100	26,786	519,663	-	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	3.0000	千ノルウェー・クロネ 2,800	千ノルウェー・クロネ 2,795	38,547	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	3,000	2,916	40,221	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.5000	3,000	2,865	39,522	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	5,900	5,629	77,634	2028/04/26	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.7500	5,200	4,831	66,629	2029/09/06	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	国債証券	1.3750	4,200	3,753	51,756	2030/08/19	
小 計			-	24,100	22,792	314,312	-	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クロナ 4,600	千スウェーデン・クロナ 5,650	74,132	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	2.5000	5,000	4,991	65,493	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	1.0000	6,200	5,894	77,329	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	3,700	3,436	45,083	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	3,700	3,387	44,440	2029/11/12	
小 計			-	23,200	23,359	306,480	-	
メキシコ	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	8.0000	千メキシコ・ペソ 21,000	千メキシコ・ペソ 20,481	141,047	2023/12/07	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	10.0000	32,000	32,203	221,771	2024/12/05	
	MEX BONOS DE DESARROLLO	国債証券	7.5000	16,000	15,296	105,340	2027/06/03	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	18,000	17,778	122,431	2029/05/31	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	40,000	38,348	264,089	2038/11/18	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	21,000	19,727	135,852	2031/05/29	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	18,000	16,447	113,265	2034/11/23	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.7500	19,000	17,388	119,745	2026/03/05	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	5,000	4,541	31,276	2047/11/07	
小 計			-	190,000	182,214	1,254,820	-	
中 国	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	千オフショア・人民元 51,000	千オフショア・人民元 51,035	996,298	2026/08/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	26,000	26,011	507,800	2024/09/02	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	23,000	23,164	452,220	2028/10/14	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7200	31,000	33,493	653,850	2051/04/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0200	43,000	43,492	849,048	2031/05/27	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2600	22,000	21,869	426,924	2025/02/24	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	26,000	25,942	506,445	2029/03/24	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	9,000	8,911	173,965	2027/04/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2400	31,000	30,762	600,540	2025/05/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,000	6,940	135,499	2027/07/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	3,000	2,970	57,995	2025/08/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	6,000	5,921	115,591	2029/09/25	
	小 計			-	278,000	280,516	5,476,180	-

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	千マレーシア・リンギット 5,100	千マレーシア・リンギット 5,045	155,333	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	6,400	6,620	203,818	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	3,200	3,228	99,384	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	6,700	6,941	213,684	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.4780	700	699	21,539	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.8820	1,500	1,506	46,384	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.9000	1,300	1,308	40,282	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVT	国債証券	3.7570	1,400	1,302	40,105	2040/05/22
小 計			-	26,300	26,653	820,533	-
ポーランド	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	千ポーランド・ズロチ 2,200	千ポーランド・ズロチ 1,818	56,008	2028/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	8,000	7,382	227,415	2024/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,800	1,568	48,320	2025/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	7,800	5,301	163,316	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	7,000	5,460	168,215	2026/10/25
小 計			-	26,800	21,531	663,275	-
ユ ー ロ				千ユーロ	千ユーロ		
アイルランド	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	5.4000	800	850	122,778	2025/03/13
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	3.4000	500	506	73,130	2024/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.4000	600	594	85,813	2030/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	2.0000	900	772	111,447	2045/02/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.0000	800	765	110,560	2026/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.7000	300	259	37,525	2037/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.9000	500	460	66,499	2028/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3000	800	697	100,623	2033/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.3500	500	456	65,882	2031/03/18
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.1000	500	458	66,212	2029/05/15
	IRISH GOVT TREASURY	国債証券	1.5000	500	380	54,962	2050/05/15
IRISH GOVT TREASURY	国債証券	0.0000	500	397	57,418	2031/10/18	
オランダ	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	5.5000	700	802	115,846	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	4.0000	1,400	1,646	237,688	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	3.7500	1,300	1,566	226,174	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	200	200	28,895	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.0000	700	695	100,404	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.7500	1,700	1,848	266,852	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	1,100	1,041	150,374	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,700	1,593	229,949	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	400	372	53,774	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	500	487	70,360	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.7500	1,500	1,375	198,546	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.2500	1,000	870	125,718	2029/07/15

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	1,700	1,250	180,544	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	2,600	2,174	313,849	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.0000	1,100	999	144,240	2027/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	0.5000	200	166	24,063	2032/07/15
ベルギー	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	1,100	1,266	182,759	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0000	1,000	1,210	174,765	2035/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.2500	1,000	1,168	168,709	2041/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5000	700	746	107,810	2026/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	500	548	79,210	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6000	400	400	57,838	2024/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	800	901	130,140	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0000	200	201	29,143	2034/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	300	288	41,653	2025/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	1,300	1,135	163,967	2031/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9000	1,000	866	125,070	2038/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0000	1,800	1,717	247,857	2026/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6000	650	501	72,342	2047/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.1500	500	432	62,396	2066/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	800	743	107,339	2027/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.5000	1,300	1,255	181,190	2024/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.2500	500	437	63,083	2057/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.4500	400	329	47,513	2037/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8000	1,600	1,465	211,603	2028/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.2500	1,100	952	137,439	2033/04/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9000	900	812	117,337	2029/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.7000	500	385	55,577	2050/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.1000	200	166	23,978	2030/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.4000	300	194	28,063	2040/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.6500	400	193	27,937	2071/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.0000	2,000	1,575	227,371	2031/10/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.3500	300	239	34,537	2032/06/22
	フランス	FRANCE O. A. T.	国債証券	6.0000	2,100	2,301	332,181
FRANCE O. A. T.		国債証券	5.5000	1,650	1,938	279,856	2029/04/25
FRANCE O. A. T.		国債証券	5.7500	400	505	73,024	2032/10/25
FRANCE OAT.		国債証券	4.7500	800	955	137,886	2035/04/25
FRANCE OAT.		国債証券	4.0000	1,370	1,690	244,060	2055/04/25
FRANCE OAT.		国債証券	4.0000	2,000	2,273	328,208	2038/10/25
FRANCE OAT.		国債証券	4.5000	2,100	2,569	370,870	2041/04/25
FRANCE OAT.		国債証券	4.0000	1,400	1,785	257,703	2060/04/25
FRANCE OAT.		国債証券	3.5000	2,100	2,168	313,008	2026/04/25
FRANCE OAT.		国債証券	2.7500	3,850	3,898	562,783	2027/10/25
FRANCE OAT.		国債証券	3.2500	900	953	137,668	2045/05/25

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	FRANCE OAT.	国債証券	2.2500	1,700	1,694	244,531	2024/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	2,600	2,561	369,800	2024/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	3,500	3,501	505,437	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,300	1,240	179,017	2025/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	1,300	1,247	180,088	2025/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	2,550	2,356	340,157	2031/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	3,500	3,276	473,021	2026/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	3,700	3,032	437,744	2036/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	800	617	89,114	2066/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.2500	3,200	2,939	424,352	2026/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.7500	3,200	2,749	396,881	2039/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.0000	1,800	1,691	244,198	2027/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	2,000	1,692	244,274	2048/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,300	3,009	434,435	2028/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.2500	1,200	1,016	146,686	2034/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,500	3,170	457,713	2028/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	4,800	4,651	671,497	2024/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	1.5000	2,400	1,797	259,441	2050/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	2,300	2,029	293,014	2029/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,900	1,795	259,216	2025/03/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	4,500	3,790	547,163	2029/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	3,000	1,791	258,587	2052/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,800	3,515	507,467	2026/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,900	3,196	461,417	2030/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	400	388	56,125	2024/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	100	44	6,379	2072/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.5000	1,200	754	108,958	2044/06/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,000	2,386	344,525	2031/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	3,000	2,839	409,903	2025/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,900	1,484	214,338	2032/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.7500	500	457	66,052	2028/02/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	3,000	2,822	407,396	2032/11/25
ド イ ツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	1,200	1,250	180,450	2024/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.5000	1,000	1,184	170,934	2027/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.6250	1,000	1,161	167,635	2028/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	1,600	1,810	261,291	2028/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	6.2500	500	631	91,217	2030/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.5000	900	1,115	161,080	2031/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	600	756	109,215	2034/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.0000	1,800	2,189	316,101	2037/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.2500	700	897	129,594	2039/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	4.7500	1,450	1,987	286,872	2040/07/04

外国債券パッシブ・マザーファンド

区分	銘柄	種類	期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	3.2500	700	826	119,296	2042/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	1,900	2,043	294,985	2044/07/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.5000	2,200	2,176	314,241	2024/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.7500	2,200	2,188	315,858	2024/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.5000	2,700	2,948	425,566	2046/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,500	2,406	347,316	2025/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,300	1,273	183,776	2024/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,300	1,257	181,516	2025/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	3,100	2,939	424,269	2026/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	2,300	2,124	306,623	2027/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,300	2,130	307,466	2027/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.2500	1,450	1,245	179,717	2048/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	2,100	1,928	278,417	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	1,500	1,348	194,653	2028/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.2500	1,800	1,604	231,674	2029/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	2,500	2,168	313,051	2029/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,000	1,775	256,356	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	800	687	99,226	2030/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,600	2,739	395,497	2035/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	5,800	4,936	712,599	2030/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,300	1,168	168,675	2027/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,500	1,249	180,352	2031/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	3,200	2,633	380,197	2032/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	1,000	843	121,698	2038/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.8000	200	191	27,669	2053/08/15
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,300	1,263	182,319	2024/04/05
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,000	958	138,388	2024/10/18
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	2,800	2,656	383,522	2025/04/11
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,800	1,690	244,037	2025/10/10
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	1,100	1,011	145,964	2026/10/09
	BUNDES OBLIGATION	国債証券	0.0000	4,200	3,818	551,153	2027/04/16
スペイン	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	6.0000	2,200	2,580	372,458	2029/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2000	1,700	1,177	169,967	2040/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.7500	1,000	1,219	175,968	2032/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.2000	1,250	1,364	196,980	2037/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.9000	1,200	1,432	206,777	2040/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.8000	2,200	2,254	325,480	2024/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.7000	1,500	1,756	253,483	2041/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	4.6500	800	839	121,241	2025/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.9000	500	554	80,026	2026/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	1,500	1,675	241,871	2028/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	5.1500	1,000	1,262	182,215	2044/10/31

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.8000	1,400	1,422	205,289	2024/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7500	2,100	2,103	303,592	2024/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.6000	1,400	1,367	197,385	2025/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.1500	1,600	1,578	227,853	2025/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	1,700	1,577	227,687	2030/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.9500	2,000	1,949	281,367	2026/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.9000	1,700	1,564	225,895	2046/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	3.4500	1,300	1,266	182,854	2066/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.3000	3,100	2,939	424,269	2026/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.5000	1,500	1,421	205,200	2027/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.3500	700	643	92,844	2033/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	1,100	1,030	148,775	2027/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	1,600	1,481	213,912	2028/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.7000	750	656	94,698	2048/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4000	2,200	2,030	293,075	2028/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	1,600	1,464	211,358	2029/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.8500	2,000	1,691	244,173	2035/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.2500	1,400	1,347	194,446	2024/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	1,000	837	120,836	2030/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.8000	1,700	1,551	223,967	2027/07/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.0000	300	171	24,707	2050/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.0000	500	472	68,264	2025/01/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.2500	3,000	2,629	379,520	2030/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	1.4500	400	207	29,979	2071/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.5000	1,400	1,117	161,358	2031/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	0.7000	2,200	1,762	254,344	2032/04/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.5500	700	658	95,104	2032/10/31
イタリア	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	7.2500	400	456	65,833	2026/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.5000	1,700	1,920	277,244	2027/11/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	2,000	2,100	303,160	2028/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6500	2,200	1,843	266,133	2030/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	6.0000	2,200	2,510	362,356	2031/05/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.7500	1,700	1,898	274,103	2033/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	2,070	2,174	313,959	2034/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.0000	2,600	2,514	362,984	2037/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,800	1,921	277,368	2039/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,000	1,039	150,024	2025/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	5.0000	1,700	1,825	263,505	2040/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,800	1,858	268,316	2026/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.5000	1,000	1,016	146,669	2024/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.7500	1,100	1,155	166,783	2044/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.7500	2,300	2,326	335,759	2024/09/01

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.5000	2,000	1,950	281,514	2030/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	1,300	1,286	185,665	2024/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.2500	1,600	1,357	195,969	2046/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5000	1,900	1,824	263,335	2025/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	1,300	1,252	180,749	2025/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.6000	1,200	1,128	162,894	2026/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.7000	1,550	1,194	172,411	2047/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2500	500	395	57,096	2036/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.2500	800	735	106,114	2026/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	600	435	62,911	2067/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	1,100	922	133,179	2033/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2000	900	851	122,907	2027/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	700	688	99,428	2024/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.4500	1,000	874	126,177	2048/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0500	1,500	1,402	202,442	2027/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	1,800	1,747	252,185	2024/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.9500	600	503	72,703	2038/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0000	3,200	2,952	426,208	2028/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	700	673	97,186	2025/05/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	1,600	1,519	219,303	2028/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5000	1,200	1,174	169,549	2025/11/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.3500	850	763	110,208	2035/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.8500	1,100	1,024	147,870	2049/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.0000	3,100	2,944	425,074	2029/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.1000	1,000	954	137,812	2026/07/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.1000	500	422	60,926	2040/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.3500	2,400	2,263	326,758	2025/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.8500	1,700	1,531	221,039	2027/01/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	1,800	1,439	207,723	2030/08/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4500	400	286	41,309	2036/03/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.4500	900	644	93,015	2050/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.8500	1,000	965	139,364	2025/07/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	800	708	102,217	2027/09/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.5000	1,000	914	131,958	2026/02/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.7000	1,500	902	130,252	2051/09/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9000	2,000	1,559	225,099	2031/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	2,600	1,985	286,673	2031/12/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.9500	2,100	1,581	228,239	2032/06/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0000	1,300	1,224	176,694	2024/12/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.1000	2,700	2,437	351,846	2027/04/01
	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.8000	1,000	935	135,030	2029/06/15
	BTPS	国債証券	0.0000	2,400	2,283	329,557	2024/08/15

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	期 末				
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
フィンランド	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	4.0000	300	311	45,016	2025/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	403	58,244	2028/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	788	113,847	2042/07/04
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	2.0000	900	895	129,251	2024/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	500	427	61,742	2031/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	700	657	94,876	2026/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	1.3750	500	396	57,293	2047/04/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	400	355	51,307	2028/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.5000	800	695	100,392	2029/09/15
	FINNISH GOVERNMENT	国債証券	0.2500	400	259	37,449	2040/09/15
オーストリア	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	6.2500	1,000	1,165	168,309	2027/07/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.1500	300	346	50,081	2037/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	4.8500	500	537	77,653	2026/03/15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.8000	700	880	127,061	2062/01/26
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	3.1500	500	531	76,745	2044/06/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	2.4000	900	866	125,109	2034/05/23
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.6500	800	788	113,863	2024/10/21
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.2000	1,000	967	139,693	2025/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	1,300	1,223	176,603	2026/10/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	700	557	80,448	2047/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	700	643	92,939	2027/04/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	700	640	92,456	2028/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.5000	550	484	69,907	2029/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	900	743	107,385	2030/02/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.7500	900	566	81,742	2051/03/20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	1.5000	200	135	19,574	2086/11/02
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.8500	150	69	10,086	2120/06/30
	REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.0000	900	722	104,354	2031/02/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	国債証券	0.9000	500	424	61,297	2032/02/20	
小 計			—	378,140	355,387	51,300,242	—
合 計			—	—	—	152,982,896	—

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



## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### ■ 投資信託財産の構成

(2022年12月19日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 152,982,896	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,745,720	98.9
投 資 信 託 財 産 総 額	154,728,616	1.1
		100.0

※期末における外貨建資産（154,175,700千円）の投資信託財産総額（154,728,616千円）に対する比率は99.6%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.22円、1カナダ・ドル=99.63円、1オーストラリア・ドル=91.27円、1シンガポール・ドル=100.44円、1ニュージーランド・ドル=87.00円、1イギリス・ポンド=165.82円、1イスラエル・シケル=39.366円、1デンマーク・クローネ=19.40円、1ノルウェー・クローネ=13.79円、1スウェーデン・クローナ=13.12円、1メキシコ・ペソ=6.886円、1オフショア・人民元=19.521円、1マレーシア・リンギット=30.785円、1ポーランド・ズロチ=30.804円、1ユーロ=144.35円です。

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年12月19日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	154,728,616,682円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	749,201,414
公 社 債(評価額)	152,982,896,578
未 収 利 息	942,268,098
前 払 費 用	54,250,592
(B) 負 債	27,106,863
未 払 解 約 金	27,102,311
そ の 他 未 払 費 用	4,552
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	154,701,509,819
元 本	77,954,604,200
次 期 繰 越 損 益 金	76,746,905,619
(D) 受 益 権 総 口 数	77,954,604,200口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,845円

※当期における期首元本額81,412,102,331円、期中追加設定元本額11,717,059,759円、期中一部解約元本額15,174,557,890円です。

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

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

### ■ 損益の状況

(自2021年12月18日 至2022年12月19日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,388,011,459円
受 取 利 息	3,388,241,031
そ の 他 収 益 金	87,605
支 払 利 息	△ 317,177
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 4,218,802,521
売 買 益	24,469,390,677
売 買 損	△28,688,193,198
(C) そ の 他 費 用 等	△ 60,550,279
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 891,341,341
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	80,981,208,508
(F) 解 約 差 損 益 金	△14,987,799,996
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	11,644,838,448
(H) 合 計(D+E+F+G)	76,746,905,619
次 期 繰 越 損 益 金(H)	76,746,905,619

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### ■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	25,699,219,523円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	5,723,489,507円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	864,451,522円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,976,908,206円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,193,210,727円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,301,306,578円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,215,238,768円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	30,338,011円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	153,997,157円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	75,478,804円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,115,153円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	631,815,767円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,041,920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>	109,386,082円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	96,060,756円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	949,869,564円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	253,631,582円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,268,921,919円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	182,685,179円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,332,150,475円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	294,968,200円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,139,989,648円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,146,332円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	176,453,310円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,092,429,430円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	196,065,249円	三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	314,642,256円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	127,100,213円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	120,661,407円
イオン・バランス戦略ファンド	337,501,691円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	67,375,516円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	24,330,578円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	30,968,221円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	82,010,179円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,592,229円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	61,886,719円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	78,931,659円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	163,669,831円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	363,615,745円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	49,154,614円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	87,450,602円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	24,004,429円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,410,392円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	171,579,317円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,460,174円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	643,974,752円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	897,907,179円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	34,145,102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>	547,164,260円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	100,150,368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>	740,186,895円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	66,880,818円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	424,473,864円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,130,696円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	278,652,069円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	817,097,768円	SMAM・年金Wリスクリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	101,287,305円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	43,737,304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>	85,173,393円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	4,137,465,188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>	109,719,316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>	30,152,077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>	717,685,989円

### ■ お知らせ

#### <約款変更について>

該当事項はございません。

# 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第20期（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年2月17日）
運用方針	主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

## ■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) TOPIX (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 株比	株式先物率 (買建-売建)	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
16期（2018年11月30日）	25,937	△ 4.8	2,475.92	△ 4.9	97.1	2.8	173,547
17期（2019年12月2日）	27,359	5.5	2,611.46	5.5	97.7	2.3	174,398
18期（2020年11月30日）	28,704	4.9	2,738.72	4.9	97.7	2.0	180,486
19期（2021年11月30日）	32,212	12.2	3,073.26	12.2	97.7	2.4	197,054
20期（2022年11月30日）	34,074	5.8	3,249.61	5.7	97.9	2.0	222,819

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

## ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年11月30日	円 32,212	% —	3,073.26	% —	% 97.7	% 2.4
12月末	33,341	3.5	3,179.28	3.4	98.1	1.9
2022年1月末	31,728	△1.5	3,025.69	△1.5	98.4	1.6
2月末	31,588	△1.9	3,012.57	△2.0	98.8	1.2
3月末	32,945	2.3	3,142.06	2.2	97.6	2.4
4月末	32,159	△0.2	3,066.68	△0.2	97.4	2.6
5月末	32,401	0.6	3,090.73	0.6	97.3	2.6
6月末	31,742	△1.5	3,027.34	△1.5	98.1	1.9
7月末	32,927	2.2	3,140.07	2.2	98.7	1.2
8月末	33,322	3.4	3,177.98	3.4	99.0	0.9
9月末	31,493	△2.2	3,003.39	△2.3	96.6	3.4
10月末	33,100	2.8	3,156.44	2.7	97.7	2.3
(期 末) 2022年11月30日	34,074	5.8	3,249.61	5.7	97.9	2.0

※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

# 1 運用経過

## ▶ 基準価額等の推移について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

### 基準価額等の推移



期首	32,212円
期末	34,074円
騰落率	+5.8%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、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（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

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

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> <li>日本銀行の金融緩和政策の維持が示されたこと</li> <li>米CPI（消費者物価指数）の結果を受けて、インフレがピークアウトし利上げペースが鈍化すると期待が広がったこと</li> </ul>
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> <li>新型コロナの新たな変異ウイルス（オミクロン型）の感染拡大やウクライナ情勢が緊迫化したこと</li> <li>欧米において金融引き締めの方針が確認され、長期金利（10年国債利回り）が上昇したこと</li> </ul>

---

▶投資環境について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

---

国内株式市場は上昇しました。

期初から3月中旬にかけては、変異ウイルス（オミクロン型）の感染急拡大や、ウクライナ情勢の緊迫化、ロシアへの経済制裁を背景とした原油市況の高騰などから世界景気の回復の遅れが懸念され、下落しました。

その後、ウクライナ情勢に対する過度な警戒感の緩和や米国の金融政策イベント通過により投資家心理が持ち直し、国内でも日本銀行の金融緩和政策の維持が示されたことで、上昇しました。6月から期末にかけては、欧米の金融政策動向に左右される形で一進一退の展開が続きました。

---

▶ポートフォリオについて（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

---

**株式組入比率**

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

**ポートフォリオの特性**

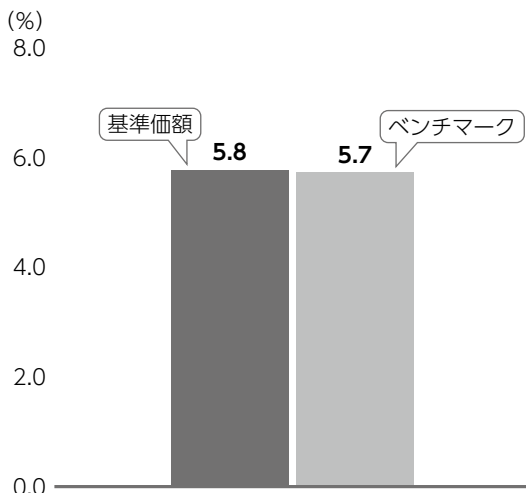
TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

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

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

## ▶ ベンチマークとの差異について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

## 基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

## 【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+5.8%となり、ベンチマークの騰落率+5.7%を0.1%上方乖離しました。

## 上方乖離要因

・先物と現物のリターンに、差が生じたこと

## 2 今後の運用方針

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

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

### ■ 1万口当たりの費用明細（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

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

期中の平均基準価額は32,526円です。

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 当期中の売買及び取引の状況（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

#### (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 14,312.2 (1,313.824)	千円 31,388,823 ( )	千株 6,390.324	千円 12,178,963

※金額は受渡し代金。

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

#### (2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 49,332	百万円 50,112	百万円 —	百万円 —

※金額は受渡し代金。



## ■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	43,567,786千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	204,530,294千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.21

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

## ■ 利害関係人との取引状況等（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

### (1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	B A	%	うち利害関係人 との取引状況D	D C	%
株 式	百万円 -	百万円 -	% -	百万円 12,178	百万円 24	% 0.2
株 式 先 物 取 引	49,332	28,561	57.9	50,112	33,581	67.0

### (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 206	百万円 9	百万円 2,553

### (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	6,618千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	3,594千円
(c) (b)／(a)	54.3%

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

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

（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

■ 組入れ資産の明細（2022年11月30日現在）

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
	千株	千株	千円	
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				
極洋	3.7	3.9	14,410	
日本水産	97.1	106.9	55,801	
マルハニチロ	15	16.2	39,787	
雪国まいたけ	8.1	10.6	10,610	
カネコ種苗	5	5.3	7,573	
サカタのタネ	11.6	13.5	63,315	
ホクト	8	9.4	17,766	
<b>鉱業 (0.3%)</b>				
住石ホールディングス	—	21.8	5,537	
日鉄鉱業	2.3	4.3	13,523	
三井松島ホールディングス	4.8	5	16,125	
INPEX	396.9	394	604,002	
石油資源開発	11.7	12.3	53,320	
K&Oエナジーグループ	5.5	4.9	11,892	
<b>建設業 (1.9%)</b>				
ヒノキヤグループ	2.9	—	—	
ショーボンドホールディングス	14.1	14.5	87,870	
ミライト・ワン	31.3	37.2	56,320	
タマホーム	6.1	7.6	18,840	
日本アクア	—	5.9	5,192	
ベステラ	3.9	—	—	
Robot Home	20.8	0.8	147	
ダイセキ環境ソリューション	2.7	—	—	
安藤・間	54.1	61.9	54,100	
東急建設	30.2	32.6	21,385	
コムシスホールディングス	31.6	35.9	88,565	
ビーアールホールディングス	17	22.2	7,481	
高松コンストラクショングループ	6.7	7.2	14,112	
東建コーポレーション	2.9	3.4	27,030	
ヤマウラ	—	7.6	7,630	
オリエンタル白石	36.7	41.3	11,481	
大成建設	66	74.2	309,043	
大林組	227.9	265.9	272,281	
清水建設	213.8	223.6	165,016	
飛鳥建設	8.7	10.4	10,628	
長谷工コーポレーション	67.2	76.9	116,657	
松井建設	11.6	2.7	1,517	
銭高組	1.7	2.1	5,640	
鹿島建設	167	164.9	255,595	
不動テトラ	5.8	6	9,144	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
大木建設	5.1	3.7	4,425	
鉄建建設	6.5	7	12,733	
西松建設	14	13.1	51,286	
三井住友建設	53.2	63.2	26,670	
大豊建設	3.5	3.3	14,652	
奥村組	13.3	12.3	36,112	
東鉄工業	9.9	10.3	26,285	
浅沼組	2.9	6.3	18,396	
戸田建設	95.7	92.7	67,856	
熊谷組	11.2	13	33,007	
北野建設	2.7	3	7,338	
矢作建設工業	12.5	11.3	8,350	
ピーエス三菱	9.3	11.1	6,693	
日本ハウスホールディングス	20.7	17.8	7,778	
新日本建設	10.6	10.7	8,003	
NIPPO	18.6	—	—	
東亜道路工業	1.4	1.7	10,370	
日本道路	2.2	1.7	10,557	
東亜建設工業	5.9	6.8	16,007	
日本国土開発	22.2	23.7	13,556	
若築建設	4.8	3.8	10,385	
東洋建設	25.7	24.8	20,757	
五洋建設	91.2	106.9	69,164	
世紀東急工業	12.8	11.2	8,937	
福田組	2.8	2.9	14,108	
住友林業	58.5	57.2	135,621	
巴コーポレーション	14.6	15.1	5,768	
大和ハウス工業	211.2	208.4	658,335	
ライト工業	14.8	13.5	27,918	
積水ハウス	247.9	233.7	599,907	
日特建設	—	8	7,288	
北陸電気工事	5.2	—	—	
ユアテック	14.1	16.6	11,935	
日本リーテック	5.8	6.3	4,624	
四電工	—	1.8	3,193	
中電工	9.9	10.1	21,058	
関電工	37.5	38.3	33,244	
きんでん	50	51.5	75,756	
東京エネシス	8.8	8.5	7,998	
トーエネック	2.9	2.7	9,234	
住友電設	5.8	6.9	17,526	
日本電設工業	11.7	11.9	20,170	

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
エクシオグループ	33.9	36.4	77,422	
新日本空調	6.3	4.4	8,439	
九電工	17.7	18.3	60,207	
三機工業	13.6	16.2	25,887	
日揮ホールディングス	70.9	74.1	140,271	
中外炉工業	3.6	2.6	4,152	
ヤマト	8.8	10.1	6,969	
太平電業	5.3	4.8	15,096	
高砂熱学工業	21.1	17.8	31,933	
朝日工業社	2.2	3.5	7,462	
明星工業	17	14	10,136	
大気社	11.1	8.9	31,461	
ダイダン	5.4	5.1	11,220	
日比谷総合設備	7.5	6.8	12,886	
フィル・カンパニー	1.7	—	—	
テスホールディングス	4.7	8.7	9,674	
インフロニア・ホールディングス	97.4	78.4	80,752	
東洋エンジニアリング	11.1	11.2	6,518	
レイズネクスト	10.8	10.5	13,177	
<b>食料品（3.5%）</b>				
ニッポン	20.1	19.4	30,787	
日清製粉グループ本社	82.2	69.1	111,596	
日東富士製粉	—	1.7	7,607	
昭和産業	6.4	6.2	15,177	
鳥越製粉	8.7	—	—	
中部飼料	8.6	10.8	11,221	
フィード・ワン	10.3	11.1	7,425	
日本甜菜製糖	5.3	5.3	8,623	
DM三井製糖ホールディングス	6.4	7.4	14,474	
日新製糖	4.3	4.1	6,900	
森永製菓	17.3	15.6	57,642	
中村屋	2.5	2.9	9,019	
江崎グリコ	20	21.6	77,436	
名糖産業	5	1.6	2,576	
井村屋グループ	4.5	4.4	9,816	
不二家	4.4	5	13,165	
山崎製パン	54.7	50.5	79,840	
モロゾフ	1.7	2.7	9,693	
亀田製菓	4.1	4.8	20,904	
寿スピリッツ	7	8	62,160	
カルビー	33.4	34.5	100,188	
森永乳業	13.6	13.8	61,341	
六甲バター	6.5	5.9	8,230	
ヤクルト本社	54.1	53.5	468,125	
明治ホールディングス	48.1	46.3	305,580	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
雪印メグミルク	17.4	18.6	32,159	
プリマハム	8.4	9.9	20,205	
日本ハム	27.7	29.3	108,410	
丸大食品	7.8	8.6	12,255	
S Foods	6.3	8.4	24,469	
柿安本店	2.9	3.2	6,947	
伊藤ハム米久ホールディングス	41.4	53.4	36,525	
サッポロホールディングス	25	24.8	89,032	
アサヒグループホールディングス	171.8	173.1	761,293	
キリンホールディングス	268.3	338.2	732,203	
宝ホールディングス	50.2	51	54,468	
オエノンホールディングス	24.5	25.6	7,219	
養命酒製造	3.7	—	—	
コカ・コーラ ボトラーズ ジャパンホールディングス	50.9	58.9	85,994	
サントリー食品インターナショナル	48.8	52.5	244,912	
ダイドーグループホールディングス	3.7	4.2	20,370	
伊藤園	22.2	27.9	147,033	
キーコーヒー	6.9	8.5	17,595	
日清オイリオグループ	8.4	10.4	34,684	
不二製油グループ本社	15.8	17.7	37,400	
かどや製油	1.4	2.9	10,150	
J-オイルミルズ	7.4	7.8	11,809	
キッコーマン	52.6	49.5	382,140	
味の素	161.3	183.4	795,039	
ブルドックソース	3.9	3.5	6,020	
キュービー	38.3	40.2	98,369	
ハウス食品グループ本社	27.2	22.9	62,150	
カゴメ	27.6	35	106,750	
焼津水産化学工業	7.7	11.7	9,734	
アリアケジャパン	6.7	6.6	30,393	
ニチレイ	34.9	34.6	96,222	
東洋水産	35	37.8	218,106	
イトアンドホールディングス	3.6	3.9	8,704	
日清食品ホールディングス	28.6	26.6	278,768	
永谷園ホールディングス	4.1	4.1	8,212	
一正蒲鉾	6.6	—	—	
フジッコ	7.5	7.8	14,781	
ロック・フィールド	7.9	9.6	14,169	
日本たばこ産業	391.8	492.9	1,387,759	
ケンコーマヨネーズ	5.2	5.5	9,080	
わらべや日洋ホールディングス	5.3	6.1	11,272	
なとり	5.2	5.2	10,712	
ビックルスコオペレーション	4.1	—	—	
ファーマフーズ	7	11.8	15,163	

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
ユーグレナ	38.5	49.3	44,419	
紀文食品	5	6.9	6,506	
ビックルスホールディングス	—	1.5	1,624	
ミヨシ油脂	5.1	3.8	3,746	
理研ビタミン	8.1	6.8	12,076	
<b>繊維製品 (0.4%)</b>				
片倉工業	—	8.2	16,195	
グンゼ	5.1	5.8	23,084	
東洋紡	29.2	34.3	35,500	
ユニチカ	23.1	27.8	7,450	
富士紡ホールディングス	3.5	3.2	10,832	
倉敷紡績	6.7	6.1	13,291	
シキボウ	8.2	7.9	6,936	
日本毛織	23.3	22.2	22,377	
帝国繊維	9.1	9	14,967	
帝人	68	73.5	97,608	
東レ	519.2	511.5	377,793	
住江織物	3.3	—	—	
アツギ	10.2	3	1,140	
ダイニック	7.4	6.3	3,899	
セーレン	15.5	14.7	38,558	
小松マテール	13	12.3	9,827	
ワコールホールディングス	18.4	14.9	34,702	
ホギメディカル	10.2	10.3	35,947	
T S I ホールディングス	27.3	29.1	13,997	
マツオカコーポレーション	3.5	—	—	
ワールド	11	10.4	13,676	
三陽商会	—	4	5,288	
オンワードホールディングス	47.4	52.1	17,193	
ルックホールディングス	—	3.4	8,489	
ゴールドウイン	13	13.4	126,228	
デサント	14.2	13.1	43,885	
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>				
特種東海製紙	4.7	4.3	12,181	
王子ホールディングス	297.1	316.8	167,270	
日本製紙	35.2	40.3	38,889	
北越コーポレーション	47.8	48.3	37,529	
大王製紙	35.2	34.2	36,388	
レンゴー	68.6	70.5	61,053	
トーモク	5.6	5.4	8,640	
ザ・バック	5.9	6	15,126	
<b>化学 (6.1%)</b>				
北の達人コーポレーション	26.6	34.5	10,419	
クラレ	103.4	121	132,616	
旭化成	473	475.3	484,330	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
昭和電工	61.9	73.7	161,255	
住友化学	520.7	562.9	280,324	
住友精化	3.6	3.3	13,992	
日産化学	38.8	36.1	243,314	
ラサ工業	2.8	3.4	7,197	
クレハ	5.6	6.5	63,245	
多木化学	2.9	3	15,750	
テイカ	6.2	5.4	6,885	
石原産業	12.2	14.3	16,030	
日本曹達	9	8.2	35,096	
東ソー	102.6	101.2	164,247	
トクヤマ	23	25	47,825	
セントラル硝子	12	12.3	42,988	
東亜合成	40.9	38.8	45,667	
大阪ソーダ	6.4	4.6	18,998	
関東電化工業	16.2	15.3	15,697	
デンカ	25.9	27.7	91,687	
信越化学工業	122.6	130.3	2,289,371	
日本カーバイド工業	—	4.4	5,750	
堺化学工業	5.2	6.2	11,649	
第一稀元素化学工業	8.4	7.6	9,142	
エア・ウォーター	67.3	71.8	115,957	
日本酸素ホールディングス	68.5	73.3	166,610	
日本化学工業	2.6	3.2	5,945	
日本パーカライジング	36.4	36.6	36,270	
高压ガス工業	13.1	12	7,776	
四国化成工業	9.4	9.2	12,429	
ステラ ケミファ	4	4.8	12,561	
保土谷化学工業	2.4	2.5	7,762	
日本触媒	12.1	11.6	63,916	
大日精化工業	5.7	5.7	9,786	
カネカ	18.4	17.2	60,200	
三菱瓦斯化学	66.2	56.5	110,796	
三井化学	64.5	63.7	197,470	
J S R	66.5	71.2	204,557	
東京応化工業	12.3	13.3	90,972	
大阪有機化学工業	6	5.9	12,466	
三菱ケミカルグループ	476.7	515.3	375,756	
K H ネオケム	11.8	12.7	35,140	
ダイセル	103.3	112.2	111,975	
住友ベークライト	11.3	11.2	48,384	
積水化学工業	148.6	157.2	302,924	
日本ゼオン	64.7	45.7	60,552	
アイカ工業	20	19.2	62,112	
U B E	33.2	39.3	78,560	

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
積水樹脂	10.8	10.7	19,356	
タキロンシーアイ	16.5	16.8	8,534	
旭有機材	4.9	5.2	13,800	
ニチバン	5.7	5.3	9,296	
リケンテクノス	19.3	17.4	8,682	
大倉工業	4.2	4	8,056	
群栄化学工業	2.5	2.2	5,332	
ミライアル	2.9	3.6	6,177	
ダイキョーニシカワ	16.3	17.4	10,266	
森六ホールディングス	5	4.4	7,730	
恵和	1.9	2.5	9,312	
日本化薬	56.8	58.1	72,508	
カーリットホールディングス	8.8	8.5	6,111	
日本精化	6	4.3	9,623	
扶桑化学工業	6.4	6.9	24,322	
トリケミカル研究所	7.3	10.3	24,833	
ADEKA	32.8	26.2	59,002	
日油	24.3	23.5	135,830	
新日本理化	20.1	19.1	4,870	
ハリマ化成グループ	7.3	6.6	5,550	
花王	161.3	185.7	1,014,107	
第一工業製薬	3.1	3.4	6,830	
石原ケミカル	4.5	4.1	5,059	
ニイタカ	2.4	2.1	4,399	
三洋化成工業	4.1	4.5	19,822	
大日本塗料	11	11.8	9,050	
日本ペイントホールディングス	268.5	336.9	377,328	
関西ペイント	74.1	70	131,390	
中国塗料	17.7	14.9	15,391	
日本特殊塗料	7	6.2	5,406	
藤倉化成	11.7	4	1,636	
太陽ホールディングス	10.4	11.5	29,198	
DIC	30.1	29.7	74,428	
サカタインクス	14.4	17	18,785	
東洋インキSCホールディングス	13.8	14.3	26,884	
T&K TOKA	8.4	7.4	7,414	
富士フイルムホールディングス	128.1	146.3	1,070,184	
資生堂	135.8	159.4	924,360	
ライオン	88	92.1	134,926	
高砂香料工業	5	5.2	14,788	
マンダム	15.7	17	24,446	
ミルボン	9.1	11.4	64,980	
ファンケル	29.5	33.4	85,704	
コーセー	13.7	15.5	224,595	
コタ	6	6.3	10,602	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ポーラ・オルビスホールディングス	31.4	39.3	70,189	
ノエビアホールディングス	6.1	6.8	39,644	
新日本製薬	3.6	4.8	6,590	
エステー	5.6	6.6	10,150	
コニシ	11.9	12.6	21,709	
長谷川香料	12.4	15.7	48,277	
小林製薬	20.4	23.3	198,050	
荒川化学工業	7.2	7.5	7,462	
メック	5.5	6.3	16,197	
日本高純度化学	—	2.4	6,009	
タカラバイオ	19	20.5	36,920	
JCU	8	8.6	28,982	
新田ゼラチン	—	5.9	6,348	
OATアグリオ	—	3.5	6,216	
デクセリアルズ	18.9	22.1	71,383	
アース製薬	6	6.9	36,708	
北興化学工業	7.8	9.7	8,817	
大成ラミック	3.3	3.9	11,992	
クミアイ化学工業	27.5	30.7	28,336	
日本農薬	16.1	14.5	10,860	
アキレス	6.2	6	8,106	
有沢製作所	11.7	13	16,692	
日東電工	44	55.2	475,272	
レック	11	11.8	9,593	
三光合成	—	12.5	5,737	
きもと	—	19.4	4,617	
藤森工業	6.4	5.9	18,850	
前澤化成工業	6.8	6.2	8,587	
未来工業	3.8	3.2	4,761	
JSP	5.2	5.6	8,327	
エフビコ	13.6	14.6	55,261	
天馬	6	6.4	13,331	
信越ポリマー	13.4	13.8	17,208	
東リ	27.3	9.1	1,920	
ニフコ	24.4	27.4	98,366	
バルカー	6	6.5	17,745	
ユニ・チャーム	140.5	159	808,197	
<b>医薬品（5.8%）</b>				
協和キリン	85.3	91.8	291,465	
武田薬品工業	572.5	675	2,733,750	
アステラス製薬	631.5	730.9	1,555,355	
住友ファーマ	45.3	56.9	60,712	
塩野義製薬	91.5	97.6	678,320	
日本新薬	19.1	18	145,620	
中外製薬	227.8	238.5	864,324	

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
科研製薬	11.5	13.3	52,402	
エーザイ	87.1	92.9	866,942	
ロート製薬	37.5	37	166,130	
小野薬品工業	167	147.3	517,906	
久光製薬	19.2	17.2	66,564	
持田製薬	9.4	8.9	30,082	
参天製薬	135.8	144	160,416	
扶桑薬品工業	3.4	3.2	6,550	
日本ケミファ	2.5	—	—	
ツムラ	22.6	24.1	72,275	
日医工	23.3	—	—	
キッセイ薬品工業	13.2	11.8	29,901	
生化学工業	13	13.5	12,730	
栄研化学	12.7	11.9	22,645	
鳥居薬品	4.1	4	11,608	
JCRファーマ	20.7	26.2	50,094	
東和薬品	10.2	11.9	25,132	
富士製薬工業	6.3	6.6	6,725	
ゼリア新薬工業	13.1	10.5	23,373	
第一三共	572.5	664.4	3,001,759	
キョーリン製薬ホールディングス	14.5	16.6	29,382	
大幸薬品	12.9	15.9	8,315	
ダイト	4.8	5.4	14,007	
大塚ホールディングス	151.3	174.4	817,936	
大正製薬ホールディングス	17.2	17.5	98,000	
ペプチドリーム	38.4	37.4	64,028	
あすか製薬ホールディングス	9.2	8.4	10,743	
サワイグループホールディングス	16	17.4	73,776	
<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>				
日本コークス工業	69.2	81.6	7,180	
ニチレキ	10.4	9.4	12,173	
ユシロ化学工業	7	10.5	8,694	
富士石油	—	20	5,500	
MORESCO	5.4	—	—	
出光興産	80.6	84.4	273,456	
ENEOSホールディングス	1,096.1	1,378.6	642,427	
コスモエネルギーホールディングス	21.2	29	112,520	
<b>ゴム製品 (0.7%)</b>				
横浜ゴム	41.8	43.3	97,641	
TOYO TIRE	38.6	44.1	69,104	
ブリヂストン	209.8	243.5	1,258,164	
住友ゴム工業	65.4	75.2	89,337	
藤倉コンポジット	7.4	6.6	5,590	
オカモト	4.4	4.5	17,325	
ニッタ	7.6	7.6	22,268	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
住友理工	15.8	15.6	9,609	
三ツ星ベルト	8.9	11.3	38,759	
バンドー化学	13	12.7	12,687	
<b>ガラス・土石製品 (0.7%)</b>				
日東紡績	11	9.4	20,529	
AGC	66.8	77.4	356,040	
日本板硝子	19.6	—	—	
日本電気硝子	29.5	31.5	79,758	
オハラ	3.8	5	6,325	
住友大阪セメント	13.8	11.3	36,555	
太平洋セメント	41.6	49.1	106,399	
日本ヒューム	12.1	9.5	6,156	
日本コンクリート工業	22.9	22.5	5,265	
三谷セキサン	3.6	3.6	15,156	
アジアパイルホールディングス	16.5	15.1	8,093	
東海カーボン	61.2	64.8	67,845	
日本カーボン	3.8	4.6	19,941	
東洋炭素	4.8	4.9	19,257	
ノリタケカンパニーリミテド	4.1	4.2	16,968	
TOTO	52.1	50.2	238,199	
日本碍子	78.7	89.7	162,446	
日本特殊陶業	55.4	58.2	155,976	
MARUWA	2.6	3	56,460	
品川リフラクトリーズ	2	2.3	9,073	
黒崎播磨	1.6	1.8	9,054	
ヨータイ	5.4	5	6,880	
東京窯業	15.3	22.5	6,075	
フジインコーポレーテッド	6	6.5	45,630	
ニチアス	17.7	20	48,360	
ニチハ	10.2	9.9	27,947	
<b>鉄鋼 (0.8%)</b>				
日本製鉄	322.2	351.2	770,006	
神戸製鋼所	133.7	173	107,260	
中山製鋼所	14.9	17.3	13,061	
合同製鐵	5.2	4.4	8,373	
JFEホールディングス	194	215	328,090	
東京製鐵	24.6	21.9	30,725	
共英製鋼	9.1	13	16,809	
大和工業	14	14.8	69,708	
東京製鋼	4.7	4.5	6,354	
大阪製鐵	—	5.6	6,356	
淀川製鋼所	9.6	8.4	21,361	
丸一鋼管	25.6	27.2	77,329	
モリ工業	2.6	2.8	7,876	
大同特殊鋼	11.9	12	52,980	

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
日本冶金工業	5.5	5.9	25,399	
山陽特殊製鋼	7.6	7.6	16,818	
愛知製鋼	4.7	7	15,911	
日立金属	77.3	—	—	
大平洋金属	4.9	8	16,400	
新日本電工	47.2	52.1	21,986	
栗本鐵工所	4.7	4.4	7,902	
三菱製鋼	5.7	6.1	6,069	
日本精線	1.5	2	8,730	
エンビプロ・ホールディングス	3.4	10	7,200	
新家工業	—	3.1	7,167	
<b>非鉄金属（0.7%）</b>				
大紀アルミニウム工業所	10.6	11.1	14,374	
日本軽金属ホールディングス	18.4	21.7	33,244	
三井金属鉱業	19.3	22.9	71,791	
東邦亜鉛	4.6	5.1	11,010	
三菱マテリアル	47.4	52.6	115,036	
住友金属鉱山	92.1	91.1	423,159	
DOWAホールディングス	19.5	17.9	80,908	
古河機械金属	11.8	11.1	14,330	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11	11.7	49,081	
東邦チタニウム	13.5	14.4	39,571	
UACJ	10.8	11.1	25,585	
CKサンエツ	2	2.2	9,295	
古河電気工業	22.6	26.3	68,301	
住友電気工業	269.8	270.6	433,095	
フジクラ	80.4	85.3	95,280	
昭和電線ホールディングス	6.4	8.9	15,975	
タツタ電線	14.9	16.1	6,939	
平河ヒューテック	5.4	5	5,490	
リョービ	10.2	8.9	11,062	
アサヒホールディングス	28.7	31.7	64,794	
<b>金属製品（0.6%）</b>				
稲葉製作所	—	8.9	12,344	
宮地エンジニアリンググループ	3.2	2.5	8,512	
トーカロ	18.4	21.4	26,578	
アルファ	4.9	7.4	7,081	
SUMCO	110.9	149.4	302,236	
川田テクノロジーズ	2.1	2.2	7,414	
RS Technologies	2.4	2.6	21,320	
信和	—	11.2	8,836	
東洋製罐グループホールディングス	46.3	52	82,888	
ホッカンホールディングス	5.4	5.8	7,673	
横河ブリッジホールディングス	12.4	10.3	19,909	
駒井ハルテック	3.1	—	—	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
三和ホールディングス	68.4	72	92,880	
文化シャッター	23	22.6	25,402	
三協立山	12	12.5	7,062	
アルインコ	8	7.5	7,500	
LIXIL	113.4	114.2	240,847	
ノーリツ	13.9	11.7	17,362	
長府製作所	7.3	7.9	15,578	
リンナイ	13.6	14.2	144,556	
日東精工	13	12.5	6,537	
岡部	18	14.2	10,209	
ジークト	9.2	8.6	13,192	
東プレ	13.7	13.9	17,500	
高周波熱錬	16.3	14.5	9,860	
東京製綱	7	5.8	5,167	
サンコール	—	8.4	5,342	
モリテックスチール	—	8.8	2,156	
パイオラックス	11	11.1	19,314	
エイチワン	9.9	—	—	
日本発条	66.8	69.5	63,592	
立川プラインド工業	5	—	—	
三益半導体工業	5.6	7	17,906	
<b>機械（5.2%）</b>				
日本製鋼所	22.2	21.4	62,488	
三浦工業	31.3	32.2	104,972	
タクマ	24.1	24	30,624	
ツガミ	17.4	17.4	20,601	
オークマ	8.5	7.7	40,117	
芝浦機械	8.3	8.7	23,855	
アマダ	113.4	121.6	133,516	
アイダエンジニアリング	19	16.3	13,610	
FUJII	33	33.3	69,064	
牧野フライス製作所	7.8	8.5	39,227	
オーエスジー	34	36.9	71,438	
旭ダイヤモンド工業	19.4	23.1	16,632	
DMG森精機	42.9	46.8	85,690	
ソディック	16.8	21	16,023	
ディスコ	10.6	12.3	499,380	
日東工器	4.8	4.4	6,714	
日進工具	6.3	6.7	7,550	
パンチ工業	—	3.3	1,389	
豊和工業	—	6.5	5,726	
石川製作所	—	3.5	5,078	
島精機製作所	10.8	12.3	25,731	
オプトラン	9.3	11.6	29,545	
NCホールディングス	3	2.5	5,240	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
イワキ	—	5.7	7,449	
フリー	7.2	8.9	10,279	
ヤマシンフィルタ	15.4	20.4	9,832	
日阪製作所	11.3	9.1	7,443	
やまびこ	13.9	13.1	14,855	
野村マイクロ・サイエンス	2	2.6	12,233	
平田機工	3.5	3.8	20,786	
ベガスサミシン製造	—	9.6	9,283	
マルマエ	3.3	4.2	7,984	
タツモ	4.2	5	8,830	
ナフテスコ	41.1	48.4	165,044	
三井海洋開発	8.2	9.9	15,137	
レオン自動機	8.6	8.7	10,179	
S M C	21.3	24.9	1,537,824	
ホソカワミクロン	5.1	6.1	17,958	
ユニオンツール	2.8	3.3	11,583	
オイレス工業	10	10.9	16,284	
日精エー・エス・ピー機械	2.7	3.6	15,156	
サトーホールディングス	9.7	11.1	21,689	
技研製作所	6.4	8.2	26,937	
日本エアーテック	4.7	5.3	6,211	
日精樹脂工業	6.5	7.2	6,890	
オカダアイヨン	—	1.4	2,165	
ワイエイシイホールディングス	—	4.1	6,010	
小松製作所	330.5	360	1,144,440	
住友重機械工業	41.6	45.3	131,913	
日立建機	29.2	30.6	98,226	
日工	13.6	13.7	8,494	
巴工業	3.5	4	9,672	
井関農機	7.7	8.5	10,854	
T O W A	6.5	8.1	15,948	
北川鉄工所	4.8	—	—	
ローツェ	3.6	4	33,560	
クボタ	355.8	406.5	825,195	
荏原実業	3.6	4	9,068	
三菱化工機	3	3.1	6,559	
月島機械	13.8	11.6	11,379	
帝国電機製作所	6.1	6.1	14,438	
新東工業	18.5	17.1	11,457	
澁谷工業	6.4	7.2	17,841	
アイチ コーポレーション	11.8	11.5	9,200	
小森コーポレーション	20.4	19.2	15,628	
鶴見製作所	6.3	6.1	12,175	
酒井重工業	—	1.8	6,345	
荏原製作所	30.3	31.4	165,164	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
西島製作所	10	7.7	11,935	
北越工業	9.1	8.8	10,146	
ダイキン工業	92.9	91.7	2,054,538	
オルガノ	2	10.5	29,589	
トーヨーカネツ	3.4	3.7	9,201	
栗田工業	39.4	42.9	261,690	
椿本チエイン	9.5	10.6	33,337	
大同工業	5.3	7.9	6,083	
木村化工機	7.5	8.6	6,020	
アネスト岩田	12.8	13.9	13,121	
ダイフク	40	39.6	278,784	
サムコ	2.3	2.7	10,435	
タダノ	39	41.4	40,572	
フジテック	27.3	28.2	84,882	
C K D	21.4	21.3	43,515	
キトー	7.2	—	—	
平和	20.4	25.8	63,081	
理想科学工業	6.4	7	16,646	
S A N K Y O	16.1	15.3	82,008	
日本金銭機械	9.1	10.5	10,647	
マースグループホールディングス	6.2	5.5	11,275	
フクシマガリレイ	5.1	5.7	24,795	
ダイコク電機	5	5.4	8,672	
竹内製作所	11	14	44,450	
アマノ	19.3	22	54,450	
J U K I	11.8	13.8	9,259	
ジャノメ	8.1	9.8	6,076	
マックス	9.9	9.4	19,354	
グローリー	19.2	20.4	47,001	
新晃工業	7	8.3	12,848	
大和冷機工業	10.5	11.6	14,210	
セガサミーホールディングス	72.5	62	113,026	
日本ピストンリング	4.4	1.2	1,449	
リケン	3.7	3.8	8,652	
T P R	10	9.8	12,073	
ツバキ・ナカシマ	16.5	18	18,630	
ホンザキ	21.3	49.5	229,432	
大豊工業	8.2	8	5,592	
日本精工	136.1	141.2	107,312	
N T N	157.9	155.1	44,979	
ジェイテクト	69.6	68	68,680	
不二越	6.1	5.7	22,059	
日本トムソン	22.1	20.4	12,423	
T H K	42.5	44.4	118,503	
ユースン精機	8.7	—	—	



国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
前澤給装工業	7.3	6.8	6,344	
イーグル工業	10	9.2	10,202	
日本ビラー工業	7.4	7.3	20,184	
キッツ	25.3	29	24,476	
マキタ	88.9	95.9	300,167	
日立造船	61.6	63.5	56,896	
三菱重工業	114.6	134.5	733,966	
IHI	45.6	48.5	182,360	
スター精密	11.6	14.6	25,623	
<b>電気機器（17.4%）</b>				
日清紡ホールディングス	44.9	63.3	64,186	
イビデン	38.2	44	242,440	
コニカミノルタ	160.3	173.4	98,664	
ブラザー工業	88.8	102.2	226,270	
ミネベアミツミ	125.2	133	298,319	
日立製作所	350.5	385.5	2,813,764	
東芝	127.3	147.9	693,651	
三菱電機	729	793.7	1,093,321	
富士電機	43.9	46.6	261,892	
安川電機	78.3	90.9	404,050	
シンフォニアテクノロジー	9.5	9.2	13,864	
明電舎	12.6	12	23,844	
オリジン	4.3	3.7	4,869	
山洋電気	3.3	3.5	21,700	
デンヨー	7	6.6	9,900	
PHCホールディングス	8	10.9	17,385	
ソシオネクスト	—	7.5	50,025	
東芝テック	7.9	11.4	42,123	
芝浦メカトロニクス	1.4	1.5	16,470	
マブチモーター	17.1	19	78,470	
日本電産	188.9	186.6	1,592,444	
トレックス・セミコンダクター	4.2	3.9	11,411	
東光高岳	5.2	5.2	9,604	
ダブル・スコープ	—	19.5	36,426	
ダイヘン	8	7.1	28,968	
ヤーマン	12.4	15.7	20,504	
JVCケンウッド	65.9	75.6	27,972	
ミマキエンジニアリング	8.5	8.5	5,559	
I-PEX	4.1	5.3	6,937	
日新電機	17.2	18.1	24,272	
大崎電気工業	18	21.4	11,406	
オムロン	60.7	70.4	495,897	
日東工業	9.8	10.5	24,475	
IDEC	9.4	11.5	37,547	
ジーエス・ユアサコーポレーション	24.4	25.6	55,321	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
メルコホールディングス	2.2	2.3	7,153	
日本電気	92.5	108.6	527,253	
富士通	65.6	76.5	1,412,572	
沖電気工業	31.1	36.6	26,644	
電気興業	4.4	4	8,400	
サンケン電気	6.9	7.2	47,736	
アイホン	4.7	5.1	9,776	
ルネサスエレクトロニクス	394.7	500.9	659,184	
セイコーエプソン	90.5	102.2	219,934	
ワコム	56.5	61.4	39,787	
アルバック	13.5	18.3	108,519	
アクセル	—	4	6,028	
EIZO	5.7	5.8	20,851	
日本信号	19.1	17.8	18,387	
京三製作所	18.7	19.4	8,031	
能美防災	9.9	10.4	16,536	
ホーチキ	6.5	6.4	9,248	
エレコム	16.8	18.5	26,862	
パナソニックホールディングス	777.6	907.3	1,155,900	
シャープ	83.3	92.8	90,294	
アンリツ	46.9	54.6	80,043	
富士通ゼネラル	19.9	21.9	70,846	
ソニーグループ	456.5	537.9	6,054,064	
TDK	105.5	121.6	593,408	
帝国通信工業	5	4.3	6,032	
タムラ製作所	29.1	34.1	27,825	
アルプスアルパイン	65.1	69.6	90,619	
日本電波工業	8.2	9.6	16,752	
鈴木	—	3	2,757	
メイコー	6	8.6	25,843	
日本トリム	2.1	2.4	5,908	
ローランドディー・ジー	4.8	4.5	13,882	
フォスター電機	9.8	9.1	8,745	
SMK	2.5	2.3	6,069	
ヨコオ	5.5	6.4	15,449	
ホシデン	17.4	18.7	30,406	
ヒロセ電機	11.2	12.7	231,140	
日本航空電子工業	17	15.7	36,847	
TOA	9.8	10.3	7,889	
マクセル	15	17.4	24,534	
古野電気	9.6	10.7	10,914	
ユニデンホールディングス	2.1	—	—	
スミダコーポレーション	7.9	8	11,696	
アイコム	3.4	3.2	8,912	
リオン	3.6	3.6	7,380	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末 評価額
	株数	株数	
横河電機	73.1	84	215,544
新電元工業	3.1	3.2	10,672
アズビル	42.7	53.1	221,692
東亜ディーケーケー	5.4	7.6	6,452
日本光電工業	29.9	35.3	112,783
チノー	—	4.2	7,728
共和電業	16.2	—	—
日本電子材料	4	6.4	9,868
堀場製作所	13.4	17	106,080
アドバンテスト	54.1	59.8	545,974
エスベック	6.2	6.6	13,582
キーエンス	66	76.1	4,348,354
日置電機	3.5	4	27,280
シスメックス	61.6	65.5	544,829
日本マイクロニクス	13.1	12.9	18,821
メガチップス	6.9	6.5	17,192
OBARA GROUP	3.7	4.4	15,334
コーセル	10.6	11.5	9,786
イリソ電子工業	6.3	7.1	33,796
オブテックスグループ	12.7	14.3	30,687
千代田インテグレ	4	4.3	10,350
レーザーテック	32	37.5	942,562
スタンレー電気	50.9	54	150,822
岩崎電気	3.6	3.1	7,892
ウシオ電機	37.6	40	71,280
ヘリオス テクノ ホールディング	—	11.5	5,129
エノモト	—	2.5	4,855
日本セラミック	6.9	8	21,176
遠藤照明	4.8	—	—
古河電池	5.6	6.2	6,962
双信電機	—	2.8	1,190
山一電機	6.1	7.1	13,099
図研	4.8	6.7	22,043
日本電子	15.2	19	86,640
カシオ計算機	53	57.1	76,514
ファナック	64	74.6	1,519,229
日本シイエムケイ	18.2	18.6	10,750
エンプラス	2.2	2.4	10,728
大真空	11.6	10.2	8,557
ローム	32.6	35.1	380,835
浜松ホトニクス	52.2	60.8	435,328
三井ハイテック	7.2	7.9	62,884
新光電気工業	21.3	26.8	101,974
京セラ	102.6	118.1	824,456
太陽誘電	35.3	37	161,505

銘柄	期首(前期末)		期末 評価額
	株数	株数	
村田製作所	214	230.5	1,720,452
双葉電子工業	14.5	17.6	10,419
北陸電気工業	6.1	1.6	2,064
ニチコン	23.1	15.9	22,482
日本ケミコン	7.3	8.1	14,912
KOA	11.2	11.8	25,948
市光工業	10.7	12.9	5,495
小糸製作所	39.9	91.1	197,231
ミツバ	15.6	16.5	8,794
SCREENホールディングス	12.7	13	117,390
キャノン電子	7.7	8.7	13,746
キャノン	362	417.3	1,340,367
リコー	202.3	190	206,340
象印マホービン	19.7	22.7	36,297
東京エレクトロン	46.2	53.6	2,416,824
イノテック	5.5	6	7,812
輸送用機器 (7.7%)			
トヨタ紡織	29.6	32	61,152
ユニプレス	12.6	15	13,230
豊田自動織機	58.9	55.3	431,893
モリタホールディングス	12.4	14	17,724
三櫻工業	11.1	12.5	8,362
デンソー	160.5	156.7	1,177,443
東海理化電機製作所	19.3	20.9	32,436
川崎重工業	53.2	57.6	168,537
日本車輛製造	3.6	3.7	7,270
三菱ロジスネクスト	10.6	14	12,516
日産自動車	859.2	1,081.7	531,331
いすゞ自動車	228.5	220.6	395,756
トヨタ自動車	3,691.1	4,175.6	8,395,043
日野自動車	91.5	99	61,380
三菱自動車工業	269.9	297.8	189,400
武蔵精密工業	16.4	18.6	32,884
日産車体	12.7	13.7	11,398
新明和工業	20.3	24.7	25,021
極東開発工業	13.4	13.7	18,673
トビー工業	7.9	6.9	11,937
ティラド	2.5	2.5	6,620
曙ブレーキ工業	44.8	53.4	8,811
タチエス	13.3	13.1	14,357
NOK	36	30	37,920
フタバ産業	20.8	24	9,000
KYB	7.5	7.4	26,825
大同メタル工業	18.4	19.6	9,702
プレス工業	39.7	35.7	16,100

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ミクニ	—	13.5	4,590	
太平洋工業	15.6	17.9	19,314	
アイシン	53.1	58.3	219,499	
マツダ	228.8	252	274,932	
本田技研工業	573.8	618	2,074,008	
スズキ	166.5	139.8	686,837	
SUBARU	208.7	241.1	566,946	
安永	5	—	—	
ヤマハ発動機	95	119.2	407,068	
TBK	14.5	18.5	4,828	
エクセディ	10.9	12.7	21,183	
豊田合成	23.5	22.2	50,660	
愛三工業	13.4	13.8	9,687	
日本プラスト	—	15.9	6,789	
ヨロズ	8.9	9	7,245	
エフ・シー・シー	11.8	13.4	19,095	
シマノ	29.4	31.1	727,118	
テイ・エス テック	30.8	34.9	56,084	
ジャムコ	6.3	2.4	3,866	
<b>精密機器 (2.7%)</b>				
テルモ	206.3	237.5	960,212	
日機装	21.7	19.5	19,519	
日本エム・ディ・エム	4.7	5	5,180	
島津製作所	93.5	92.3	385,814	
JMS	8.1	—	—	
長野計器	5.9	6.4	7,392	
ブイ・テクノロジー	3.4	4.1	11,041	
東京計器	6.8	7	8,239	
愛知時計電機	—	3.8	5,202	
インターアクション	3.9	5.1	8,073	
オーバル	—	8	4,016	
東京精密	12.2	16.6	72,044	
マニー	29.6	33.6	75,936	
ニコン	111.7	118.4	157,945	
トプコン	34.7	40.3	66,374	
オリンパス	382.7	475.4	1,333,972	
理研計器	5.7	4.8	24,000	
タムロン	5.7	5.7	19,750	
H O Y A	142.3	164.3	2,310,058	
ノーリツ鋼機	6.7	7.3	19,228	
A&Dホロンホールディングス	7.6	11.1	11,577	
朝日インテック	80.1	100.5	242,607	
シチズン時計	83.8	83.7	50,220	
リズム	3.4	3	5,292	
メニコン	24	26.2	76,111	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
松風	3.6	3.7	8,991	
セイコーグループ	10.1	11.8	37,347	
ニプロ	55.6	64.5	65,596	
<b>その他製品 (2.4%)</b>				
スノーピーク	9.6	13.3	30,124	
パラマウントベッドホールディングス	14	17.3	46,381	
トランザクション	5.5	6.6	8,487	
ニホンフラッシュ	7.2	7.8	7,527	
前田工織	8	8.4	27,258	
永大産業	20.5	27.2	6,147	
アートネイチャー	9.3	8.9	6,915	
バンダイナムコホールディングス	65.3	69.4	627,723	
S H O E I	7.2	8	44,320	
フランスベッドホールディングス	12.4	10.6	9,879	
パイロットコーポレーション	12.7	11.9	58,905	
萩原工業	5.8	6.5	6,909	
フジシールインターナショナル	17.7	15.5	28,969	
タカラトミー	31	35.3	44,336	
広済堂ホールディングス	5.4	5.5	10,697	
プロネクス	7.6	7.5	7,245	
ウッドワン	—	5	4,660	
大建工業	4.6	5	10,690	
凸版印刷	110.4	98.9	210,854	
大日本印刷	86	89.8	255,121	
共同印刷	3.1	2.7	7,840	
N I S S H A	15.2	14.6	25,681	
TAKARA & COMPANY	4.8	5.8	12,116	
アシックス	64.7	70.3	207,736	
ローランド	5.2	5.7	23,142	
小松ウオール工業	—	3	5,520	
ヤマハ	43.3	47.8	258,598	
河合楽器製作所	2.4	2.2	5,673	
クリナップ	—	9.7	6,499	
ビジョン	44.3	49	100,156	
キングジム	8.4	7.9	7,062	
リンテック	15.8	15.2	34,169	
イトーキ	19.7	18.1	9,683	
任天堂	41.2	480.2	2,830,298	
三菱鉛筆	12.1	10.9	15,194	
タカラスタンダード	16.4	14.2	18,800	
コクヨ	35.1	36.5	65,955	
ナカバヤシ	11.4	3.3	1,653	
グローブライト	6.5	6.2	16,603	
オカムラ	26.7	22.5	31,837	
美津濃	7.4	7.6	21,804	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
<b>電気・ガス業 (1.2%)</b>			
東京電力ホールディングス	545.7	686.3	342,463
中部電力	221	278.9	359,223
関西電力	275.5	292.3	340,821
中国電力	113.7	121.9	87,158
北陸電力	68.2	73.7	39,576
東北電力	168	186.2	121,588
四国電力	66.5	65.8	49,547
九州電力	147.8	174.3	125,147
北海道電力	64.2	75.2	34,140
沖縄電力	15.5	19.1	20,131
電源開発	62.1	57.5	121,785
エフオン	6.4	6.8	3,726
イーレックス	10.9	13.5	34,047
レノバ	14.2	20.3	55,439
東京瓦斯	139.3	160.6	405,675
大阪瓦斯	131.1	153.6	325,939
東邦瓦斯	33.4	30	80,730
北海道瓦斯	5.5	5	8,460
広島ガス	20.4	13.7	4,658
西部ガスホールディングス	8.4	7.1	11,913
静岡ガス	18.8	17	18,700
メタウォーター	8.5	9.4	16,816
<b>陸運業 (3.2%)</b>			
SBSホールディングス	5.2	6.6	19,569
東武鉄道	70.3	83.1	275,061
相鉄ホールディングス	23.7	25.4	55,626
東急	182.9	212.2	371,137
京浜急行電鉄	93.3	86.6	124,704
小田急電鉄	107.7	115	207,230
京王電鉄	37.7	40.2	205,824
京成電鉄	50.7	48.9	191,443
富士急行	8.8	9.4	46,248
新京成電鉄	3.5	—	—
東日本旅客鉄道	128.4	129.1	1,008,400
西日本旅客鉄道	88.4	97.5	569,010
東海旅客鉄道	60.7	58.7	976,181
西武ホールディングス	95.6	92.4	127,512
鴻池運輸	11.9	13.1	20,711
西日本鉄道	20.5	20.2	56,681
ハマキョウレックス	5.2	5.9	20,207
サカイ引越センター	3.3	3.7	17,001
近鉄グループホールディングス	68.4	75.7	370,930
阪急阪神ホールディングス	85.7	100.7	432,003
南海電気鉄道	31.5	36.4	109,564

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
京阪ホールディングス	30.8	31.4	108,644
神戸電鉄	2.8	2.8	9,058
名古屋鉄道	56.5	84	189,756
山陽電気鉄道	6.7	6.3	14,080
アルプス物流	—	6	6,960
日本通運	23.8	—	—
ヤマトホールディングス	96.6	97.2	222,879
山九	19.1	19.3	95,438
丸全昭和運輸	5.7	4.7	15,134
センコーグループホールディングス	33.2	39.8	40,436
トナミホールディングス	1.9	1.8	6,570
ニッコンホールディングス	23.7	24.3	58,781
福山通運	11.2	6.3	22,050
セイノーホールディングス	46.6	47	56,588
神奈川中央交通	2.5	2.5	8,412
日立物流	13.6	16.7	148,463
AZ-COM丸和ホールディングス	14.3	18.5	27,010
C&Fロジホールディングス	7.8	7.8	9,562
九州旅客鉄道	53.7	54.1	163,652
SGホールディングス	130.4	145.4	309,702
NIPPON EXPRESS ESホールディングス	—	28.1	227,329
<b>海運業 (0.6%)</b>			
日本郵船	57.5	202	613,474
商船三井	38.1	133.3	448,554
川崎汽船	21.3	64.7	168,090
NSユニテッド海運	4	4.2	15,876
明治海運	9.3	9.3	6,705
飯野海運	33	29	27,057
乾汽船	5.3	10.6	19,366
<b>空運業 (0.5%)</b>			
日本航空	158.6	185.8	507,791
ANAホールディングス	175.6	207.3	610,394
パスコ	—	3.2	4,259
<b>倉庫・運輸関連業 (0.1%)</b>			
トランコム	2	2.2	17,424
日新	6.3	6.3	12,814
三菱倉庫	22.1	16.2	54,108
三井倉庫ホールディングス	7.5	7.1	25,098
住友倉庫	23.7	20.4	40,840
澁澤倉庫	4.6	3.5	7,273
東陽倉庫	19.9	27.4	7,041
日本トランスシティ	16.4	16	8,016
川西倉庫	3.5	5.2	5,231
安田倉庫	7.4	—	—

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
東洋埠頭	5.9	0.9	1,154	
上組	37.3	37.4	104,682	
キューソー流通システム	—	6.6	6,817	
近鉄エクスプレス	12.7	—	—	
エアイテイー	5.9	5.4	7,759	
内外トランスライン	3.2	3.2	7,052	
日本コンセプト	3	2.9	5,066	
<b>情報・通信業 (8.8%)</b>				
NECネットエスアイ	23.2	25.3	41,542	
クロスキャット	—	4.8	7,675	
システナ	101.2	126.9	53,298	
デジタルアーツ	3.9	4.9	31,605	
日鉄ソリューションズ	10.1	12.7	43,624	
キューブシステム	—	5.7	5,796	
コア	4	3.9	5,733	
手間いらざ	1.1	1.3	6,695	
ラクーンホールディングス	6	8.5	10,710	
ソリトンシステムズ	5	5.1	5,941	
ソフトクリエイトホールディングス	3.3	3.4	11,968	
T I S	68.1	85.4	332,206	
グリー	44.1	41.9	32,179	
コーエーテックモホールディングス	22.8	47.8	113,525	
三菱総合研究所	3.1	3.7	19,055	
ファインデックス	8.7	8	4,416	
ブレインパッド	2	8.2	7,322	
K L a b	15.4	17.2	8,428	
ポルトゥウィンホールディングス	11.6	13.7	12,836	
ネクソン	161.4	197.1	570,407	
アイスタイル	26	25.3	13,611	
エムアップホールディングス	2.3	9.6	12,998	
エイチーム	5.9	7	5,803	
エニグモ	8.9	11.2	6,686	
コロブラ	24.4	30	20,580	
ブロードリーフ	37.1	46.4	23,014	
クロス・マーケティンググループ	—	4.2	3,288	
デジタルハーツホールディングス	4.2	5.2	9,828	
システム情報	7	7.4	6,645	
メディアアドゥ	2.7	3.5	6,685	
じげん	25.2	25.2	8,996	
ブイキューブ	7.8	10.2	8,109	
サイバーリンクス	—	3.1	3,506	
ディー・エル・イー	—	8.6	2,889	
フィックスターズ	10.6	9.6	13,209	
CARTA HOLDINGS	3.5	4.2	7,140	
オブティム	6	7.3	8,482	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
セレス	3	—	—	
S H I F T	3.6	5.6	161,672	
ティーガイア	7	8.1	13,381	
テクマトリックス	12.6	14.3	23,537	
プロシップ	—	3.9	5,955	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19.8	23.8	49,504	
GMOペイメントゲートウェイ	13.9	17.4	211,584	
システムリサーチ	3.1	2.7	5,483	
インターネットイニシアティブ	19.1	42.4	103,880	
さくらインターネット	12.8	11.1	5,849	
ヴィンクス	—	1	1,682	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1.8	2.5	10,000	
S R Aホールディングス	4.2	4.1	12,812	
朝日ネット	—	9.4	5,367	
e B A S E	10.2	12.1	7,502	
アバントグループ	8.3	9.8	14,700	
アドソル日進	3.7	4	6,032	
フリービット	5.3	5.7	6,589	
コムチュア	8	10.3	26,852	
アステリア	7.9	7.5	6,090	
アイル	4.4	4.4	8,760	
マークライnz	4.1	4.5	12,523	
メディカル・データ・ビジョン	10	12.2	12,224	
g u m i	11	13.3	9,802	
テラスカイ	3.3	3.6	10,080	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4.3	4.5	8,932	
P C Iホールディングス	5.9	—	—	
ネオジャパン	—	0.9	900	
P R T I M E S	1.7	2.2	5,451	
ラクス	24.7	36.2	62,264	
ダブルスタンダード	2.4	3.4	7,524	
オープンドア	4.7	5.7	11,211	
アカツキ	3.5	4.2	9,550	
Ubicomホールディングス	2.5	2.8	6,426	
カナミックネットワーク	10.6	12.8	8,256	
チェンジ	13.2	18.8	41,002	
シンクロ・フード	—	6.4	3,046	
オークネット	4.5	4.3	8,389	
マクロミル	17.5	18	19,854	
オロ	2.6	2.9	5,414	
ユーザーローカル	3.4	3.2	5,088	
マネーフォワード	10.9	17.2	84,022	
電算システムホールディングス	3.3	4	9,088	
プロトコーポレーション	8.6	10	12,600	
野村総合研究所	138.1	156.3	468,274	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
サイバネットシステム	—	8.4	8.4	8,122	
日本システム技術	—	3.9	3.9	6,762	
インテージホールディングス	9.3	10.6	10.6	16,239	
ソースネクスト	37.9	41.1	41.1	11,466	
インフォコム	8.1	9.9	9.9	20,255	
シンプレクス・ホールディングス	7.4	12.9	12.9	29,940	
HEROZ	2.4	3.3	3.3	4,115	
ラクスル	7.9	11	11	33,715	
メルカリ	—	33.6	33.6	94,449	
I P S	2.7	2.7	2.7	8,302	
F I G	—	11.9	11.9	4,867	
システムサポート	—	3.9	3.9	5,818	
イーソル	6.5	3.1	3.1	2,824	
アルテリア・ネットワークス	9.8	8.3	8.3	10,375	
ウイングアーク1st	4.7	8.1	8.1	17,973	
サーバーワークス	1.4	1.8	1.8	5,052	
S a n s a n	25.6	29	29	48,430	
ギフトィ	6.5	8.5	8.5	19,218	
ベース	1.5	2.6	2.6	10,049	
J M D C	—	12.6	12.6	64,512	
フォーカスシステムズ	7.2	7	7	7,014	
クレスコ	6.1	6.3	6.3	10,930	
フジ・メディア・ホールディングス	69.2	73.6	73.6	79,267	
オービック	22.5	25.4	25.4	551,180	
ジャストシステム	10.2	11.2	11.2	36,960	
T D C ソフト	7.4	6.7	6.7	9,842	
Zホールディングス	1,040.9	1,087.2	1,087.2	406,069	
トレンドマイクロ	38.3	44.1	44.1	300,321	
日本オラクル	14.6	14.8	14.8	118,844	
アルファシステムズ	2.1	2.4	2.4	10,176	
フューチャー	7.4	18.9	18.9	31,581	
C A C H o l d i n g s	5.3	4.9	4.9	7,506	
S B テクノロジー	3.6	3.6	3.6	7,416	
オービックビジネスコンサルタント	6.8	15	15	70,125	
伊藤忠テクノソリューションズ	32.5	40.8	40.8	136,680	
アイティフォー	10.4	11.3	11.3	9,051	
東計電算	—	1.4	1.4	8,274	
大塚商会	38.6	43.3	43.3	197,881	
サイボウズ	9.8	10.8	10.8	23,965	
電通国際情報サービス	10.2	9.1	9.1	41,632	
A C C E S S	10.5	10.3	10.3	7,704	
デジタルガレージ	11.9	13.6	13.6	54,468	
イーエムシステムズ	14.8	13.5	13.5	13,338	
ウェザーニューズ	2.2	2.8	2.8	21,308	
C I J	7.3	7.8	7.8	7,285	

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
ビジネスエンジニアリング	—	2	2	4,438	
WOWOW	4	5.8	5.8	7,261	
スカラ	10.3	10	10	7,470	
インテリジェント ウェイブ	—	5.3	5.3	4,271	
I M A G I C A G R O U P	7.3	7	7	5,285	
ネットワンシステムズ	27.3	28.6	28.6	97,240	
アルゴグラフィックス	5.7	7	7	26,600	
マーベラス	14.3	13.6	13.6	9,234	
エイベックス	13	13.5	13.5	20,641	
B I P R O G Y	22.5	28.2	28.2	92,637	
兼松エレクトロニクス	3.9	4.8	4.8	21,912	
都築電気	4.4	4.6	4.6	6,136	
T B S ホールディングス	43.7	39.1	39.1	61,308	
日本テレビホールディングス	59.8	67.6	67.6	71,588	
朝日放送グループホールディングス	10.9	2.6	2.6	1,617	
テレビ朝日ホールディングス	17.6	18.8	18.8	25,774	
スカパーJ S A T ホールディングス	60.7	68.6	68.6	34,848	
テレビ東京ホールディングス	5.8	6	6	11,046	
ビジョン	12.7	10.5	10.5	14,458	
USEN-NEXT HOLDINGS	7	7	7	16,457	
コネクシオ	5.7	5.3	5.3	6,354	
日本通信	—	75.2	75.2	16,694	
日本電信電話	836.5	977.2	977.2	3,732,904	
K D D I	521.6	589.4	589.4	2,423,023	
ソフトバンク	1,083.9	1,225.3	1,225.3	1,834,886	
光通信	8.4	9	9	172,530	
エムティーアイ	10.4	9.1	9.1	4,604	
G M O インターネットグループ	25.7	28.5	28.5	72,247	
ファイバーゲート	3.4	5.3	5.3	4,982	
K A D O K A W A	21	40.5	40.5	102,991	
学研ホールディングス	11.1	13.8	13.8	14,158	
ゼンリン	13.6	13.6	13.6	11,709	
アイネット	5.8	5.8	5.8	7,569	
松竹	4.9	4.5	4.5	53,550	
東宝	42.2	47.6	47.6	251,804	
東映	2.3	2.1	2.1	39,711	
エヌ・ティ・ティ・データ	190	238.5	238.5	501,327	
ピー・シー・エー	4.9	5.3	5.3	6,794	
ビジネスブレイン太田昭和	3.3	4	4	7,804	
D T S	13.1	16.3	16.3	53,708	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	33.3	38.4	38.4	237,696	
シーイーシー	8.8	11.1	11.1	16,794	
カプコン	67.4	75.7	75.7	316,047	
アイ・エス・ビー	4.7	4.5	4.5	5,886	
ジャステック	5.9	5.6	5.6	6,708	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末 評価額
	株数	株数	
S C S K	49.6	61.9	136,303
N S W	3.3	3.3	7,161
アイネス	7.6	6	8,664
T K C	11.9	13.2	49,302
富士ソフト	7.6	8.5	69,190
N S D	22.8	26.7	68,352
コナミグループ	26.1	32.7	210,915
福井コンピュータホールディングス	3.7	5.4	15,897
J B C Cホールディングス	5.9	5.9	11,558
ミロク情報サービス	7.6	7.6	11,407
ソフトバンクグループ	429.1	441.1	2,625,427
<b>卸売業（5.9%）</b>			
高千穂交易	—	3.3	7,227
伊藤忠食品	2	1.8	9,342
エレマテック	7	7.4	11,366
あらた	5.6	6.2	24,955
トーメンデバイス	1.2	1.3	7,241
東京エレクトロニクス デバイス	2.1	3	20,610
円谷フィーズホールディングス	10	7.2	17,078
双日	78.9	85.3	207,961
アルフレッサ ホールディングス	79.7	81.1	135,112
横浜冷凍	21.5	24.1	23,979
ラサ商事	—	5.8	5,852
アルコニックス	7.9	11.4	14,991
神戸物産	55.7	62.2	222,365
あい ホールディングス	10.6	12.8	28,416
ダイワボウホールディングス	34.8	32.9	71,590
マクニカホールディングス	16.9	19.5	67,177
ラクト・ジャパン	2.8	3.6	7,635
グリムス	3.3	3.5	6,352
バイタルケ-エスケー・ホールディングス	14.7	13.4	11,068
八洲電機	8.4	7.8	7,917
メディアスホールディングス	—	6.8	5,202
レスターホールディングス	6.6	7.6	16,864
ジュテックホールディングス	3.1	4.7	5,419
T O K A Iホールディングス	33.6	39.5	34,602
三洋貿易	8.9	8.9	10,137
ビューティガレージ	1.5	1.8	5,427
ウイン・パートナーズ	5.6	5.6	5,555
シップヘルスケアホールディングス	22.9	29.1	80,694
コメダホールディングス	16.3	20.3	48,963
アセンテック	3.7	—	—
フルサト・マルカホールディングス	7.1	8	31,760
ヤマエグループホールディングス	6.2	5	7,165
小野建	7.3	8.2	11,840

銘柄	期首(前期末)		期末 評価額
	株数	株数	
佐島電機	6.2	6.1	8,222
伯東	4.8	4.7	17,554
コンドーテック	7.6	7.3	7,329
ナガイレーベン	9.8	10.5	21,073
三菱食品	6.4	8.3	26,975
松田産業	5.3	6.2	14,278
第一興商	13.9	15.7	64,213
メディバルホールディングス	77.1	83.6	152,988
S P K	5.3	4.8	6,676
萩原電気ホールディングス	3.5	3.7	9,312
アズワン	5.1	11.8	72,098
スズデン	—	3.8	8,713
尾家産業	5	4.7	4,352
シモジマ	6.3	6.2	5,958
ドウシシャ	7.5	8.5	12,954
高速	5.2	4.4	7,779
リックス	—	2	4,412
丸文	8.6	8.6	7,826
ハビネット	6.9	7.2	13,975
日本ライフライン	21.9	24.3	23,012
タカショー	7.4	9.1	6,406
I D O M	22.5	25.1	18,774
進和	5	5.8	11,936
ダイトロン	3.6	3.6	8,805
シークス	11.1	11.7	16,368
オーハシテクニカ	5.4	4.9	6,855
白銅	2.8	3.2	7,977
伊藤忠商事	501.7	495.4	2,123,779
丸紅	706.9	633	979,884
高島	—	1	2,970
長瀬産業	39.2	37.2	75,106
蝶理	4.8	4.4	8,742
豊田通商	71.9	70	366,100
三共生興	12.8	17.3	8,355
兼松	25.5	30.7	46,909
三井物産	557	588.6	2,344,393
日本紙パルプ商事	3.9	4.3	21,629
カメイ	8.8	8.9	10,688
スターゼン	5.9	6.4	13,292
山善	28.6	21.4	21,400
椿本興業	1.8	1.5	5,992
住友商事	452.5	497.6	1,118,107
内田洋行	3.2	3.7	17,168
三菱商事	537.7	502.5	2,314,012
第一実業	3.3	3.1	13,144

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
キャノンマーケティングジャパン	17.7	18.6	57,846	
西華産業	5.2	4.1	6,359	
佐藤商事	6.9	6.1	7,295	
菱洋エレクトロ	5.4	7.4	17,375	
東京産業	8.5	8.4	6,636	
ユアサ商事	6.6	7.1	25,489	
神鋼商事	2	2.2	9,944	
阪和興業	14.1	14.3	51,194	
正栄食品工業	4.6	5.5	23,512	
カナデン	7.7	7.3	8,051	
菱電商事	6.5	6.7	11,296	
岩谷産業	17.1	18.4	106,168	
ナイス	3	3.4	4,481	
極東貿易	2.7	6	7,950	
アステナホールディングス	12.1	17.8	7,422	
三愛オプリー	17.7	22.3	28,811	
稲畑産業	14.7	16.3	38,614	
G S I クレオス	5.4	5.6	8,164	
明和産業	7	11.6	8,131	
ワキタ	15.6	15.5	18,569	
東邦ホールディングス	23	20.8	44,304	
サンゲツ	20.2	20.5	43,070	
ミツロコグループホールディングス	10.9	11.8	12,484	
シナネンホールディングス	3	2.7	10,260	
伊藤忠エネクス	14.9	19.3	19,686	
サンリオ	22.6	23	104,075	
サンワテクノス	5.1	4.8	7,324	
リョーサン	8.1	8.8	25,009	
新光商事	12.7	12.1	13,612	
トーヨー	5.2	4.2	7,270	
三信電気	4.4	3.7	8,310	
東陽テクニカ	8.7	9.5	13,290	
モスフードサービス	9.4	12	38,160	
加賀電子	6.5	6.6	28,974	
ソーダニッカ	10.9	—	—	
立花エレテック	6.2	6	10,656	
P A L T A C	10.1	12.7	54,800	
三谷産業	—	19.1	5,978	
太平洋興発	7.7	9.5	7,106	
西本Wismettacホールディングス	2	2.2	8,140	
コーア商事ホールディングス	7.7	6.6	4,098	
K P P グループホールディングス	17.8	19.3	18,759	
ヤマタネ	4.7	5	8,480	
日鉄物産	4.9	5.2	26,520	
泉州電業	2.2	3.8	10,594	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
トラスコ中山	14.5	16.8	35,061	
オートボックスセブン	24.8	29	42,282	
モリト	9.5	7.8	5,912	
加藤産業	9.7	9.5	33,202	
イエローハット	12.2	14.1	24,308	
J K ホールディングス	6.8	6.8	7,085	
日伝	6	5	8,500	
杉本商事	4.2	3.8	7,835	
因幡電機産業	18.6	20.2	56,196	
東テック	3	2.8	9,170	
ミスミグループ本社	90	121.3	406,355	
タキヒヨー	3.8	6.6	5,940	
スズケン	28.2	25	92,375	
ジェコス	7.5	2	1,606	
小売業 (4.5%)				
ローソン	15.9	20.2	99,485	
サンエー	5	6	26,160	
カワチ薬品	5.9	6.6	13,932	
エービーシー・マート	11.1	11.7	81,549	
ハードオフコーポレーション	—	4.2	5,980	
アスクル	11.9	19.7	31,145	
ゲオホールディングス	10.2	8.8	17,256	
アダストリア	7.9	10	20,070	
くら寿司	7.5	9.6	32,160	
キャンドウ	3.9	4.5	9,688	
パルグループホールディングス	7	8.2	19,852	
エディオン	30.8	31.5	39,501	
サーラコーポレーション	16.5	17.9	13,425	
ハローズ	3.4	3.7	11,077	
フジオフードグループ本社	7.9	7.5	10,410	
あみやき亭	2.7	—	—	
ひらまつ	—	26.4	4,910	
大黒天物産	2.4	3	15,840	
ハニーズホールディングス	7.1	7.8	9,578	
アルペン	5.7	6.8	13,804	
クオールホールディングス	9.3	11.7	13,338	
ジンズホールディングス	5	5	21,625	
ビックカメラ	41.5	53.5	67,677	
D C M ホールディングス	43.3	49.3	56,596	
M o n o t a R O	90.9	113.9	266,070	
アーランドサービスホールディングス	6.1	6.9	15,331	
J・フロント リテイリング	86.3	100.6	116,595	
ドトール・日レスホールディングス	12.2	14.3	24,181	
マツキヨココカラ&カンパニー	44	48.8	279,136	
ブロンコピリー	5.1	5	12,500	



## 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
Z O Z O	49.6	53.3	182,552	
トレジャー・ファクトリー	—	2.6	6,229	
物語コーポレーション	3.8	4.5	31,590	
三越伊勢丹ホールディングス	125.5	135.7	179,666	
H a m e e	—	4.3	3,788	
ウエルシアホールディングス	37.9	41.8	126,236	
クリエイトSDホールディングス	10.2	13	39,845	
チムニー	4.8	7.5	8,452	
シュッピン	7.1	6.5	9,555	
オイシックス・ラ・大地	10.3	11	21,197	
ネクステージ	14.4	18.4	56,764	
ジョイフル本田	20.1	25.6	47,334	
鳥貴族ホールディングス	3.6	3.7	9,046	
ホットランド	7.6	7.4	11,299	
すかいらーくホールディングス	93.1	110.6	176,517	
S F Pホールディングス	5.1	5	8,555	
綿半ホールディングス	7	6.8	9,227	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	19.4	27.8	30,607	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5	4.2	7,312	
B E E N O S	4	4.7	14,946	
あさひ	6.3	6.8	9,057	
日本調剤	5.2	6.1	7,307	
コスモス薬品	7.2	9.1	127,036	
セブン&アイ・ホールディングス	280.9	277.3	1,547,056	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	38.8	61.1	57,372	
ツルハホールディングス	15.6	19.8	175,626	
サンマルクホールディングス	7.7	7.3	12,337	
フェリシモ	—	5	5,135	
トリドールホールディングス	17.7	20.1	54,109	
T O K Y O B A S E	8.3	—	—	
J Mホールディングス	5.6	7.2	12,664	
アレンザホールディングス	6.4	6.6	6,494	
串カツ田中ホールディングス	2.5	3.6	6,490	
パロックジャパンリミテッド	7.7	1.4	1,118	
クスリのアオキホールディングス	7.2	8.1	61,398	
力の源ホールディングス	—	6.2	5,635	
FOOD & LIFE COMPANIES	42	46.4	115,768	
メディカルシステムネットワーク	8.6	5.3	2,141	
ノジマ	11.5	26.2	36,549	
カッパ・クリエイト	11.3	13.5	18,603	
ライトオン	—	9.2	5,851	
良品計画	82.7	104.1	150,840	
アドヴァングループ	9.4	11	9,790	
アルビス	3.3	3.1	7,390	

銘柄	期首(前期末)	期		末
	株数	株数	評価額	評価額
G-7ホールディングス	8.1	9.9	15,077	
イオン北海道	13.2	13.2	15,549	
コジマ	13.4	16.2	9,946	
コーナン商事	10.3	10.9	36,079	
エコス	3.3	3.7	6,782	
ワタミ	10.4	11	11,649	
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	143.5	180.4	430,073	
西松屋チェーン	15.7	18.1	25,249	
ゼンショーホールディングス	35.4	43.9	152,113	
幸楽苑ホールディングス	6.8	6.8	7,004	
サイゼリヤ	10.9	13.7	38,538	
V Tホールディングス	27.9	31.1	15,798	
フジ・コーポレーション	5.6	5.1	6,568	
ユナイテッドアローズ	7.8	9	16,965	
ハイデイ日高	10.3	12.1	23,691	
コロワイド	30.2	37.7	67,445	
壱番屋	5.2	6.3	28,696	
スギホールディングス	14.4	16.3	100,897	
薬王堂ホールディングス	3.9	4.6	11,868	
スクロール	11.9	12.8	9,100	
ヨンドシーホールディングス	7.6	7.6	13,163	
木曾路	10	12.9	27,631	
S R Sホールディングス	14.6	16	13,552	
千趣会	17.9	17.1	6,993	
リテールパートナーズ	9.6	12	14,844	
ケーヨー	15.2	13.9	12,551	
上新電機	7.8	7.1	13,525	
日本瓦斯	34.9	43.3	91,059	
ロイヤルホールディングス	12.7	15.8	37,872	
いなげや	9.3	8.1	9,590	
チヨダ	12.1	10.2	7,782	
ライフコーポレーション	6.7	7.1	17,444	
リンガーハット	9.7	11.3	24,803	
M r M a x H D	11.6	12.2	8,076	
A O K Iホールディングス	15.6	15.9	10,907	
オークワ	12.5	13.5	12,717	
コメリ	10.7	12.3	31,857	
青山商事	17.1	18.2	18,181	
しまむら	8.3	9.4	117,406	
高島屋	52.7	61.3	109,481	
松屋	15.4	14.4	14,040	
エイチ・ツー・オー リテイリング	33.2	39.5	48,190	
近鉄百貨店	3.4	4	9,860	
丸井グループ	61	59.3	138,406	

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
アクシアル リテイリング	5.5	5.4	18,333	
イオン	276.1	272.8	770,114	
イズミ	13.1	12.4	37,386	
平和堂	12.5	13.2	26,809	
フジ	8.7	12.5	23,350	
ヤオコー	8.2	9.1	60,970	
ゼビオホールディングス	10.6	11.3	10,644	
ケースホールディングス	65.7	64.3	73,302	
Olympicグループ	—	8	4,192	
日産東京販売ホールディングス	21.5	—	—	
シルバーライフ	—	2.5	3,892	
Genky DrugStores	3.2	4.1	14,186	
ブックオフグループホールディングス	5.6	5.2	6,832	
ギフトホールディングス	1.6	1.9	7,505	
アインホールディングス	10.6	11.2	75,376	
元氣寿司	2.8	3.3	10,494	
ヤマダホールディングス	263.4	331	157,887	
アークランズ	11.5	12.3	18,425	
ニトリホールディングス	28.6	32.6	507,419	
グルメ杵屋	10.8	8.7	8,673	
ケーユーホールディングス	—	3.3	4,290	
吉野家ホールディングス	25.6	32	74,272	
松屋フーズホールディングス	3.6	3.8	15,181	
サガミホールディングス	13.7	14.2	17,338	
関西フードマーケット	5.9	8.1	11,250	
王将フードサービス	4.7	5.1	30,906	
ブレナス	8.3	—	—	
ミニストップ	6.6	7	9,961	
アークス	13.1	14.2	29,805	
パローホールディングス	15.4	15.1	26,545	
ベルク	3.2	3.9	22,308	
大庄	—	7.8	8,275	
ファーストリテイリング	9.6	12.1	977,801	
サンドラッグ	27	30.6	111,996	
サックスパー ホールディングス	—	9.4	7,520	
やまや	—	3.5	8,666	
ベルーナ	16.7	19.7	13,573	
<b>銀行業 (5.6%)</b>				
いよぎんホールディングス	—	88.1	64,224	
しずおかフィナンシャルグループ	—	168	168,840	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	—	62.3	60,306	
めぶきフィナンシャルグループ	369.6	372	116,064	
東京きらばしフィナンシャルグループ	9.7	9.7	23,153	
九州フィナンシャルグループ	141.4	126.7	50,299	
ゆうちょ銀行	168.2	212.4	223,232	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
富山第一銀行	16.8	21.1	11,984	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	406.8	410.5	195,808	
西日本フィナンシャルホールディングス	47	47.6	41,602	
三十三フィナンシャルグループ	8.7	7.4	11,100	
第四北越フィナンシャルグループ	11.7	11.1	29,059	
ひろぎんホールディングス	106.2	97.8	61,809	
おきなわフィナンシャルグループ	7	7.6	16,294	
十六フィナンシャルグループ	10.1	10	26,400	
北國フィナンシャルホールディングス	7.4	6.4	28,512	
プロクレアホールディングス	—	9.7	20,942	
あいちフィナンシャルグループ	—	10.4	23,036	
新生銀行	46.7	22.7	53,095	
あおぞら銀行	39.4	46.7	121,186	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,609.1	4,906.5	3,704,898	
りそなホールディングス	822.5	953.5	630,168	
三井住友トラスト・ホールディングス	135.1	138.1	608,606	
三井住友フィナンシャルグループ	497.6	546.5	2,553,794	
千葉銀行	240.4	207.6	173,138	
群馬銀行	133.9	144.5	65,169	
武蔵野銀行	11.2	9.9	18,641	
千葉興業銀行	—	22	8,272	
筑波銀行	—	41.1	8,713	
七十七銀行	22.9	24.1	46,946	
青森銀行	5.6	—	—	
秋田銀行	4.3	5.9	9,935	
山形銀行	10.6	10	12,170	
岩手銀行	6	6	11,610	
東邦銀行	73.1	67.9	14,259	
東北銀行	4	—	—	
みちのく銀行	4.5	—	—	
ふくおかフィナンシャルグループ	59.8	59.6	160,383	
静岡銀行	173.8	—	—	
スルガ銀行	63.4	67.7	29,043	
八十二銀行	155.6	150.8	78,265	
山梨中央銀行	10.8	9.4	9,804	
大垣共立銀行	14.2	14.5	26,738	
福井銀行	8	8.1	11,858	
清水銀行	4.4	1.5	2,293	
富山銀行	2.4	3.4	5,936	
滋賀銀行	13.5	12.4	32,438	
南都銀行	11.6	11.5	26,852	
百五銀行	69.9	72.4	25,340	
京都銀行	25.5	23.5	133,950	
紀陽銀行	25.1	26.4	40,154	
ほくほくフィナンシャルグループ	44.6	48.6	45,149	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
山陰合同銀行	43.9	47	35,485	
中国銀行	55.9	—	—	
伊予銀行	91.9	—	—	
百十四銀行	9.2	8.1	14,531	
四国銀行	13.4	14.4	13,233	
阿波銀行	11.3	11.1	22,666	
大分銀行	5.5	5.8	11,484	
宮崎銀行	5.4	5.8	13,444	
佐賀銀行	4.5	5.4	8,694	
琉球銀行	18.2	21	17,535	
セブン銀行	210.5	268.2	70,000	
みずほフィナンシャルグループ	919.4	1,081.3	1,856,592	
山口フィナンシャルグループ	83.1	83.2	67,891	
長野銀行	—	3.3	4,118	
名古屋銀行	5.8	5.1	16,396	
北洋銀行	109.8	117.9	28,885	
愛知銀行	2.9	—	—	
中京銀行	4.7	—	—	
愛媛銀行	13.1	12	10,572	
京葉銀行	33.5	38.4	20,928	
栃木銀行	46	38.2	12,262	
東和銀行	17.4	16.6	9,080	
トモニホールディングス	60.3	64.9	22,650	
フィデアホールディングス	8.5	9.5	12,929	
池田泉州ホールディングス	94.2	106.3	24,661	
<b>証券・商品先物取引業 (0.7%)</b>				
F P G	26.4	31.2	36,348	
ジャパンインベストメントアドバイザー	6.7	6.7	8,220	
S B Iホールディングス	88.2	107.9	282,482	
ジャフコ グループ	9.2	25.4	61,137	
大和証券グループ本社	538.1	529.9	322,179	
野村ホールディングス	1,098.6	1,374.4	688,162	
岡三証券グループ	56.7	66.1	25,580	
丸三証券	24.3	29.9	12,617	
東洋証券	—	29.1	8,235	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	79.2	81.2	28,988	
水戸証券	24.7	23.7	5,356	
いちよし証券	16.3	17	10,404	
松井証券	35.3	44.7	35,134	
マネックスグループ	58.6	84.3	36,249	
極東証券	9.7	12.9	7,946	
岩井コスモホールディングス	8.1	10	12,740	
アイザワ証券グループ	12.5	11.9	8,175	
スパークス・グループ	38.7	8.7	14,850	
<b>保険業 (2.4%)</b>				
かんぽ生命保険	72.5	91.2	208,574	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
SOMPOホールディングス	126.8	128.3	777,369	
アニコム ホールディングス	22.2	29	21,025	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	161	168.4	690,440	
第一生命ホールディングス	353.9	381.2	969,582	
東京海上ホールディングス	236.7	753.5	2,130,144	
T & Dホールディングス	186.2	201.2	335,601	
アドバンスクリエイティブ	4	7.4	7,932	
<b>その他金融業 (1.1%)</b>				
全国保証	17.3	19.7	100,470	
ジェイリース	2.8	2.8	8,694	
イントラスト	5.1	—	—	
日本モーゲージサービス	4.1	7.6	6,536	
アルヒ	12.2	16.2	16,313	
プレミアグループ	4.2	12.9	24,832	
ネットプロテクションズホールディングス	—	26	12,376	
クレディセゾン	45.8	47.8	83,984	
芙蓉総合リース	7.4	6.8	59,772	
みずほリース	11.1	10.9	36,024	
東京センチュリー	13.7	13.8	65,136	
日本証券金融	29.4	31.4	32,216	
アイフル	121.5	126.3	51,530	
リコーリース	6.8	7.3	26,645	
イオンフィナンシャルサービス	38.5	42.6	62,579	
アコム	141.9	140.9	45,228	
ジャックス	8.2	8	31,240	
オリエンタコーポレーション	196.9	19.8	23,700	
オリックス	436.7	499.8	1,104,807	
三菱HCキャピタル	261	287.4	187,959	
日本取引所グループ	181.9	210.6	416,040	
イー・キャランティ	11.2	12.5	30,737	
NECキャピタルソリューション	3.4	4	8,320	
<b>不動産業 (2.1%)</b>				
大東建託	23.4	27.5	421,300	
いちご	83.3	89	27,501	
日本駐車場開発	93.1	95.8	23,566	
スター・マイカ・ホールディングス	5.2	9	6,444	
S R Eホールディングス	1.9	3.9	17,842	
ヒューリック	170.8	175	201,775	
三栄建築設計	3.9	4.7	7,228	
野村不動産ホールディングス	38.1	46.8	155,376	
三重交通グループホールディングス	18.4	18.9	9,298	
サムティ	10.1	10.1	22,967	
ディア・ライフ	12.8	13.5	8,410	
地主	7	7.3	14,862	

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
ブレサンスコーポレーション	10.8	11.4	18,114	
J P M C	5.6	5.8	6,066	
フージャースホールディングス	13.3	13.7	10,918	
オープンハウスグループ	22.8	27.4	158,372	
東急不動産ホールディングス	210.2	225.5	167,321	
飯田グループホールディングス	60.2	65.6	143,860	
And Doホールディングス	—	5.8	4,947	
シーアールイー	3.1	4.2	6,262	
ケイアイスター不動産	3.4	4.4	21,692	
グッドコムアセット	4.4	8.4	6,342	
ジェイ・エス・ビー	2.1	2.1	9,166	
ロードスターキャピタル	—	3.7	6,438	
パーク24	38.9	58.8	117,894	
バラカ	4.4	4.4	8,395	
宮越ホールディングス	4.3	0.8	707	
三井不動産	327.6	325.8	904,583	
三菱地所	471.9	475.7	922,858	
平和不動産	13	13	53,170	
東京建物	71	71.6	137,543	
ダイビル	18.9	—	—	
京阪神ビルディング	12.9	11	14,102	
住友不動産	150.8	135.8	504,632	
テオーシー	16.2	16.8	12,213	
東京楽天地	2.1	1.9	8,274	
スターツコーポレーション	10.4	11.4	31,327	
フジ住宅	11.6	13.7	8,987	
空港施設	13.2	12.6	6,791	
明和地所	—	9.3	5,868	
ゴールドクレスト	6.9	8.1	14,288	
エスリード	—	4.5	8,496	
日神グループホールディングス	15.4	17.1	7,353	
日本エスコ	16.1	19.5	16,341	
M I R A R T Hホールディングス	37.4	43	16,770	
A V A N T I A	7.8	—	—	
イオンモール	35.8	39.5	65,372	
カチタス	18.2	20.6	65,199	
トーセイ	11.5	13.5	18,927	
サンフロンティア不動産	11.7	13.5	15,822	
F Jネクストホールディングス	8.8	9.2	8,887	
グランディハウス	—	4.1	2,246	
日本空港ビルデング	27.5	26.7	166,074	
<b>サービス業 (5.4%)</b>				
日本工営	4.3	5.8	20,445	
L I F U L L	27.1	34.3	8,540	
M I X I	16	18	44,352	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ジェイエイシーリクルートメント	6.1	7.1	18,367	
日本M&Aセンターホールディングス	114.5	134.6	247,664	
メンバーズ	2.6	2.6	5,891	
U Tグループ	10.1	11.6	31,262	
アイティメディア	3.9	3.3	6,144	
E・Jホールディングス	4.8	5.7	7,438	
夢真ビーネックスグループ	18.8	28.6	54,969	
コシダカホールディングス	19.2	23.8	27,298	
パソナグループ	7.5	9.5	19,551	
リンクアンドモチベーション	16.6	23.2	16,495	
エス・エム・エス	23.9	30	108,300	
パーソルホールディングス	69.7	87.8	276,570	
リニカル	6.8	6.4	4,659	
クックパッド	29.6	36	7,632	
学情	—	4.1	6,141	
スタジオアリス	4	4.7	9,808	
シミックホールディングス	5.4	5.1	8,858	
総合警備保障	27.6	29.3	109,142	
カカコム	51.7	58.7	142,523	
アイロムグループ	3.2	3.1	6,875	
セントケア・ホールディング	—	5.8	4,953	
ルネサンス	6.7	7.1	6,397	
ディップ	12.3	13.8	56,511	
デジタルホールディングス	5.4	6.8	8,071	
新日本科学	9.2	8.5	23,485	
ベネフィット・ワン	25.3	36.6	79,056	
エムスリー	123	154.6	650,093	
アウトソーシング	40.4	47.2	47,577	
ウェルネット	15.2	9.6	6,163	
ワールドホールディングス	3.2	4	11,620	
ディー・エヌ・エー	27	33.8	62,530	
博報堂D Yホールディングス	96.8	100.5	133,765	
ぐるなび	14.7	15	6,285	
タカミヤ	14.9	14	5,390	
ジャパンベストレスキューシステム	5.7	5.9	5,144	
ファンコミュニケーションズ	23.3	18.4	8,114	
ライク	—	3.4	7,078	
エスプール	19.8	22.8	21,409	
W D Bホールディングス	3.5	4.2	9,983	
アドウェイズ	11.5	11.5	6,290	
バリューコマース	5.5	6.3	13,173	
インフォマート	77.1	82.9	37,636	
J Pホールディングス	26.3	27.4	7,617	
プレステージ・インターナショナル	26.8	33.8	24,065	
アミューズ	4.7	4.9	8,780	

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
ドリームインキュベータ	—	2.8	7,912	
クイック	6.1	6.5	13,539	
電通グループ	71.9	82.2	361,680	
びあ	2.8	2.9	9,512	
イオンファンタジー	3.7	3.7	10,815	
シーティーエス	9.8	10.2	8,517	
H. U. グループホールディングス	18.6	23.4	64,935	
アルプス技研	6.8	7.1	14,846	
日本空調サービス	10	10.3	7,292	
オリエンタルランド	82.3	82.8	1,632,816	
ダスキン	16.5	17.7	52,268	
明光ネットワークジャパン	12.3	14.3	8,823	
ファルコホールディングス	4.5	4.5	8,131	
ラウンドワン	19.8	66.3	40,443	
リゾートトラスト	32.5	31.3	76,215	
ビー・エム・エル	9	9.7	33,562	
りらいあコミュニケーションズ	11.5	13	13,351	
リソー教育	33.8	39.9	12,887	
早稲田アカデミー	—	5.6	6,456	
ユー・エス・エス	78.2	80.7	185,287	
東京個別指導学院	8.5	12.1	6,400	
サイバーエージェント	172	187.7	230,683	
楽天グループ	358.3	345.7	225,742	
クリーク・アンド・リバー社	4.2	4.9	10,084	
モーニングスター	16.6	15.2	7,144	
テー・オー・ダブリュー	—	22	6,534	
山田コンサルティンググループ	5	4.9	5,605	
セントラルスポーツ	3.9	3.6	8,697	
フルキャストホールディングス	6.1	7.5	23,062	
エン・ジャパン	11.3	14.3	35,006	
テクノプロ・ホールディングス	41.9	52.7	199,733	
アイ・アールジャパンホールディングス	3.3	4.4	7,955	
Keeper 技研	4.6	5.7	24,253	
Gunosy	—	6.2	4,147	
イー・ガーディアン	3.3	3.3	9,457	
ジャパンマテリアル	21.5	24	58,392	
ベクトル	10.5	13	16,653	
チャーム・ケア・コーポレーション	6	7.3	8,453	
キャリアリンク	3.4	3.3	9,949	
I B J	7.4	5.6	5,488	
アサンテ	5.2	5.2	8,325	
バリュートHR	4	7.5	12,562	
M&Aキャピタルパートナーズ	5.7	7.4	35,927	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4	4.2	4,716	
ERIホールディングス	2.6	3.8	4,104	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
シグマクス・ホールディングス	4.5	12.3	16,408	
ウィルグループ	6.1	7	9,520	
メドピア	5.4	6.5	10,718	
リクルートホールディングス	537.4	578.7	2,505,192	
エラン	9.7	10.5	10,762	
日本郵政	910.1	1,025.7	1,105,704	
ベルシステム24ホールディングス	10.3	10.9	14,693	
鎌倉新書	9.2	9.7	8,148	
エアトリ	4.7	5.4	14,434	
アトラエ	5.6	6.6	9,748	
ストライク	2.9	3.9	17,413	
ソラスト	17.3	22.1	18,144	
セラク	2.8	3.3	4,088	
インソース	7	9.8	33,075	
ペイカレント・コンサルティング	4.9	58	258,970	
Orchestra Holdings	1.8	2	4,610	
アイモバイル	2.8	5	6,330	
グレイステクノロジー	11.9	—	—	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	21.9	27.7	48,253	
ウェルビー	5.6	6.9	5,940	
エル・ティール・エス	1.3	1.3	4,543	
ミダックホールディングス	3.1	4.8	16,176	
日総工産	7.7	—	—	
キュービーネットホールディングス	4.4	5.2	7,763	
R P Aホールディングス	12.1	13.6	3,903	
マネジメントソリューションズ	3.6	4.6	17,595	
フロンティア・マネジメント	—	3.4	4,777	
カーブスホールディングス	19.7	24.4	23,960	
フォーラムエンジニアリング	—	0.7	609	
FAST FITNESS JAPAN	—	3.2	4,272	
ダイレクトマーケティングミックス	4	9.3	13,903	
ポピンズ	2.1	—	—	
L I T A L I C O	5.9	6.2	14,495	
アドバンテッジリスクマネジメント	5.7	—	—	
リロググループ	38.6	44	99,572	
東祥	6	7	8,582	
ビーウィズ	—	3.3	3,917	
T R Eホールディングス	9.8	16.7	26,235	
人・夢・技術グループ	3.5	3.8	8,002	
エイチ・アイ・エス	15.6	20.8	41,912	
ラックランド	3.7	3.3	9,764	
共立メンテナンス	12.5	13.4	81,740	
イチネンホールディングス	8.2	8.9	11,142	
建設技術研究所	4.6	4.2	13,671	

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
スペース	—	7.2	6,408	
燦ホールディングス	4.4	4.1	7,466	
東京テアトル	6.1	9	10,269	
ナガワ	2.2	2	15,320	
東京都競馬	5.3	6.8	27,404	
カナモト	12.2	14.6	32,777	
西尾レントオール	6.5	7.3	22,557	
トランス・コスモス	9	9.7	31,379	
乃村工藝社	30.1	34.3	35,397	
藤田観光	—	4.1	12,218	
KNT-CTホールディングス	—	5.7	9,861	
日本管財	7.2	7.9	20,081	
トーカイ	6.1	7.2	13,456	
セコム	68.7	79.6	675,406	
セントラル警備保障	3.9	4.6	11,219	
丹青社	15.5	16.1	12,847	
メイテック	8.6	31.6	80,516	
応用地質	7.6	7.7	16,139	
船井総研ホールディングス	14.4	16.5	46,117	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
オオバ	8.1	—	—	
学究社	—	4.9	8,751	
ベネッセホールディングス	23.8	29.9	59,530	
イオンディライト	8.5	8.6	25,155	
ダイセキ	12.8	16	75,200	
ステップ	—	3.6	6,462	
合計	株数・金額	千株	千株	千円
	銘柄数<比率>	78,890.9	88,126.6	218,143,627
		1,659銘柄	1,724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 4,557	百万円 —
T O P I X		

## ■ 投資信託財産の構成

(2022年11月30日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円 218,143,627	% 97.5
コール・ローン等、その他	5,615,182	2.5
投資信託財産総額	223,758,810	100.0

## 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

(2022年11月30日現在)

項 目	期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>223,548,520,349円</b>
コール・ローン等	3,272,840,597
株 式(評価額)	218,143,627,430
未 収 入 金	414,739,700
未 収 配 当 金	1,741,212,622
差入委託証拠金	△ 23,900,000
<b>(B) 負 債</b>	<b>729,179,742</b>
未 払 金	124,125,858
未 払 解 約 金	605,043,303
その他未払費用	10,581
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>222,819,340,607</b>
元 本	65,393,298,021
次期繰越損益金	157,426,042,586
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>65,393,298,021口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>34,074円</b>

※当期における期首元本額61,173,269,127円、期中追加設定元本額11,653,465,066円、期中一部解約元本額7,433,436,172円です。

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

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

### ■ 損益の状況

(自2021年12月1日 至2022年11月30日)

項 目	当 期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>5,416,252,082円</b>
受 取 配 当 金	5,415,660,123
受 取 利 息	36,384
そ の 他 収 益 金	1,872,280
支 払 利 息	△ 1,316,705
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>6,363,803,273</b>
売 買 益	21,992,241,699
売 買 損	△ 15,628,438,426
<b>(C) 先 物 取 引 等 損 益</b>	<b>521,076,300</b>
取 引 益	1,128,293,600
取 引 損	△ 607,217,300
<b>(D) そ の 他 費 用 等</b>	<b>△ 109,623</b>
<b>(E) 当期損益金(A+B+C+D)</b>	<b>12,301,022,032</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>135,881,050,625</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 16,899,287,962</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>26,143,257,891</b>
<b>(I) 合 計(E+F+G+H)</b>	<b>157,426,042,586</b>
<b>次期繰越損益金(I)</b>	<b>157,426,042,586</b>

※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	9,574,760,676円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,456,182,387円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	1,036,137,254円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,446,188,375円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,637,683,641円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,623,103,466円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,605,989,911円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	37,493,396円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	147,542,223円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	135,694,110円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	4,234,860円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	684,565,549円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	19,508,324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>	44,118,775円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	63,979,125円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	254,234,553円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	165,870,052円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	796,235,497円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	149,775,143円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	533,449,238円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	266,593,539円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,657,079,267円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,398,015,768円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	372,784円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	22,016,808,347円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	36,667,207円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	179,974,667円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	39,482,192円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	253,617,658円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	32,479,210円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	167,938,880円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,795,425円
イオン・バランス戦略ファンド	20,272,782円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	95,429,547円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	41,931,085円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	219,105,114円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	191,067,731円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	52,522,560円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	178,416,019円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	38,723,328円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	669,872,498円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,680,964円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	375,434,831円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	41,326,285円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	427,891,807円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	542,525,688円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	49,851,584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）	167,317,059円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	813,757,842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>	202,591,112円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	39,664,361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>	85,721,825円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	202,349,704円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	94,168,528円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	191,586,051円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	44,811,453円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,500,206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>	42,807,427円
日興FWS・日本株インデックス	1,276,658,198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>	5,577,900円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	18,140,230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>	7,187,543円
SMAM・国内株式バジッブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,564,092,115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>	92,673,351円
バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定>	11,882,906円	SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,136,348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>	74,050,540円		

### ■ お知らせ

#### <約款変更について>

・2022年4月の東京証券取引所の市場区分の見直しに伴い、関連する記載について、所要の変更を行いました。

（適用日：2022年4月4日）



# 外国株式インデックス・マザーファンド

第20期（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

信託期間	無期限（設定日：2003年5月19日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。</li> <li>・外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。</li> </ul>

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

## ■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	投資信託 証券 組入比率	純資産額
	円	%	(配当込み、 円ベース)	%				
16期（2018年11月30日）	34,678	2.6	360.38	2.8	93.7	3.9	2.3	174,245
17期（2019年12月2日）	38,813	11.9	404.43	12.2	95.2	2.1	2.7	232,418
18期（2020年11月30日）	42,581	9.7	444.41	9.9	96.8	0.9	2.3	254,097
19期（2021年11月30日）	58,337	37.0	609.64	37.2	95.5	2.2	2.4	353,818
20期（2022年11月30日）	61,258	5.0	641.79	5.3	93.1	4.7	2.3	442,201

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 比 (買建-売建)	投 資 信 託 証 券 組 入 率
	騰 落 率	騰 落 率	(配当込み、 円ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2021年11月30日	円 58,337	% —	609.64	% —	% 95.5	% 2.2	% 2.4
12月末	60,720	4.1	634.87	4.1	95.7	1.7	2.4
2022年 1 月末	56,460	△3.2	590.55	△3.1	95.5	1.3	2.4
2 月末	56,082	△3.9	587.08	△3.7	96.2	1.2	2.4
3 月末	62,054	6.4	649.34	6.5	94.3	3.2	2.4
4 月末	59,396	1.8	621.24	1.9	95.7	1.8	2.7
5 月末	59,238	1.5	620.50	1.8	93.5	4.0	2.5
6 月末	57,862	△0.8	605.98	△0.6	94.9	2.7	2.5
7 月末	60,148	3.1	629.01	3.2	94.6	2.9	2.6
8 月末	60,564	3.8	633.65	3.9	95.5	2.0	2.5
9 月末	57,591	△1.3	602.08	△1.2	95.4	2.3	2.4
10 月末	63,111	8.2	660.71	8.4	94.4	3.3	2.3
(期 末) 2022年11月30日	61,258	5.0	641.79	5.3	93.1	4.7	2.3

※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（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

### 基準価額等の推移



期首	58,337円
期末	61,258円
騰落率	+5.0%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）です。

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

## ▶ 基準価額の主な変動要因（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

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

上昇要因	・ 主要通貨に対して円安が進行したこと
下落要因	・ インフレ懸念の高まりに伴うFRB（米連邦準備制度理事会）の金融引き締めへの転換、グローバルの景気減速懸念などから、2022年に入って以降、株式市場が下落したこと

▶ 投資環境について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

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

**株式市場**

期初から年末にかけて、好調な企業決算の発表が相次いだことを好感した他、世界的にロックダウン（都市封鎖）措置の解除などを受けて経済再開への期待が株式市場を押し上げました。

しかし、2022年1月に入るとF R Bの金融政策スタンスがインフレ懸念の高まりから積極的な利上げ姿勢へ転じたことから金利が上昇し、バリュエーション（投資価値評価）調整から成長株主導で下落しました。加えて、中国のロックダウンやロシアによるウクライナ侵攻などにより、世界的に経済に対する不透明感が広がったこともマイナス要因となりました。

4月以降も、米国の雇用統計や消費者物価指数が強い内容となったことでF R B高官から利上げに前向きな発言が相次ぎ、株式市場は軟調な展開が継続しました。

また、期末にかけて米国を中心に世界各国の中央銀行による利上げが続きましたが、利上げペースの緩和期待や堅調な企業の決算発表に伴い反発する局面も見られ、一進一退の展開となりました。

期間を通じてみると、世界の株式市場は、下落しました。

**為替市場**

米ドル・円相場は、期初では米国で金融政策が正常化するとの見方が広がったことや経済指標が改善したことなどを受けて、米ドル高・円安が進みました。その後も日銀が金融緩和を継続する中、F R Bが金融引き締めへ舵を切ったことなどから、円安が進みました。

期末にかけても、パウエル議長が利上げ継続を強調したことなどを受けて日米金利差が改めて意識され、円安が一段と進行しました。

ユーロ・円相場は、期初から2月中旬にかけては概ねもみ合いで推移しましたが、3月にかけてはロシアのウクライナ侵攻などの地政学リスクにより一時急激なユーロ安・円高となりました。4月以降はユーロ圏でも利上げの織込みが進み、ユーロ高・円安となりました。7月にはE C B（欧州中央銀行）が11年ぶりの利上げを実施し、その後も物価上昇圧力が顕在化していることから更なる利上げ観測が進み、円安が一段と進みました。

期間を通じてみると、為替市場では、米ドル、ユーロとも対円で上昇しました。

▶ポートフォリオについて（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

株式組入比率

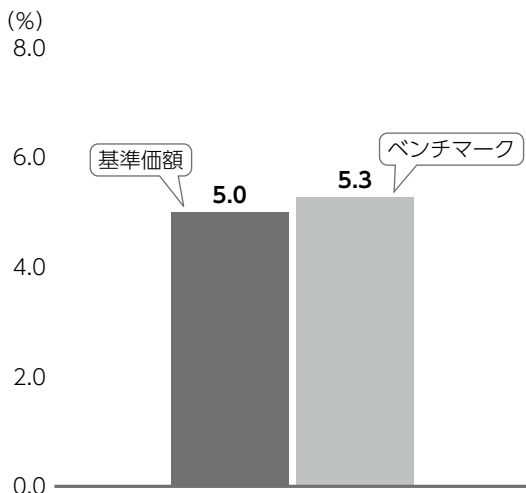
M S C I コクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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

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

▶ベンチマークとの差異について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+5.0%となり、ベンチマークの騰落率+5.3%から0.3%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストが生じたこと

## 2 今後の運用方針

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

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

### ■ 1万口当たりの費用明細（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 （株 式） （先物・オプション） （投資信託証券）	3円 （2） （1） （0）	0.005% （0.003） （0.001） （0.000）	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 （株 式） （投資信託証券）	4 （4） （0）	0.007 （0.007） （0.000）	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 （保 管 費 用） （そ の 他）	22 （20） （2）	0.037 （0.034） （0.003）	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	29	0.049	

期中の平均基準価額は59,181円です。

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

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 当期中の売買及び取引状況 (2021年12月1日から2022年11月30日まで)

(1) 株 式

		買		付		売		付				
		株	数	金	額	株	数	金	額			
外	ア	メ	リ	カ	百株 41,799.26 ( 14,016)	千アメリカ・ドル 435,643 (△ 7,275)	百株 8,357.87	千アメリカ・ドル 74,615				
	カ	ナ	ダ	4,965.97 ( 807.54)	千カナダ・ドル 30,627 (△ 0)	1,865.62	千カナダ・ドル 4,872					
	オ	ー	ス	ト	ラ	リ	ア	千オーストラリア・ドル 24,204 (△ 589)	3,208.07	千オーストラリア・ドル 4,291		
	香	港	7,567 ( -)	千香港・ドル 32,321 (△ 25)	3,596	千香港・ドル 3,635						
	シ	ン	ガ	ポ	ー	ル	2,587	千シンガポール・ドル 2,344	83	千シンガポール・ドル 98		
	ニ	ュ	ー	ジ	ー	ラ	ン	ド	1,305.94	千ニュージーランド・ドル 837	1,722.48	千ニュージーランド・ドル 1,052
	イ	ギ	リ	ス	28,189.6 ( 3,198.26)	千イギリス・ポンド 20,435 (△ 428)	9,200.07	千イギリス・ポンド 6,947				
	イ	ス	ラ	エ	ル	2,721.7	千イスラエル・シケル 5,216	-	千イスラエル・シケル -			
	ス	イ	ス	2,128.04 ( 1,794.49)	千スイス・フラン 17,459 (△ 181)	434.06	千スイス・フラン 3,373					
	デ	ン	マ	ー	ク	634.44	千デンマーク・クローネ 29,747	225.58	千デンマーク・クローネ 5,984			
	ノ	ル	ウ	ェ	ー	717.44 ( 128.85)	千ノルウェー・クローネ 17,485 ( 4,121)	247.34	千ノルウェー・クローネ 3,241			
	ス	ウ	ェ	ー	デ	ン	5,820.22 ( 3,590.73)	千スウェーデン・クローナ 92,020 (△ 5,274)	2,504.37	千スウェーデン・クローナ 13,806		
	ユ	ー	ロ	132.05	873	10.35	61					
	オ	ラ	ン	ダ	3,002.34 ( 109.55)	9,979 (△ 15)	479.66	1,551				
	ベ	ル	ギ	ー	334.79 ( 16.52)	1,845 ( -)	69.38	351				
ル	ク	セ	ン	ブル	グ	263.09	342	136.38	145			
フ	ラ	ン	ス	3,092.2 ( 391.11)	16,423 (△ 596)	1,022.29	3,086					

## 外国株式インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ド イ ツ	2,920.79 ( 233.4)	13,497 (△ 223)	880.37	2,556
	ポ ル ト ガ ル	572.07	384	1,985.62	170
	ス ペ イ ン	4,808.06 ( 354.11)	3,734 (△ 1)	739.68	540
	イ タ リ ア	7,307.6 ( -)	2,971 (△ 1)	4,778.89	593
	フ ィ ン ラ ン ド	1,227.86	1,648	227.23	370
	オ ー ス ト リ ア	71.7	309	96.31	160

※金額は受渡し代金。

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

### (2) 投資信託証券

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国	ア メ リ カ		千アメリカ・ドル		千アメリカ・ドル
	AGNC INVESTMENT CORP	—	—	25,432	311
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,792	606	1,040	205
	SIMON PROPERTY GROUP INC	3,220	386	—	—
	BOSTON PROPERTIES INC	1,769	174	—	—
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843	576	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,225	371	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	5,253	429	1,417	103
	EQUINIX INC	1,214	833	220	143
	AMERICAN TOWER CORP	5,596	1,395	1,367	324
	SUN COMMUNITIES INC	1,041	170	—	—
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613	850	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	8,620	171	—	—
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,093	742	—	—
	REALTY INCOME CORP	8,388	574	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,086	365	—	—
	INVITATION HOMES INC	4,239	159	—	—
	VICI PROPERTIES INC	24,329	744	—	—
	KIMCO REALTY CORP	35,169	827	—	—
	VENTAS INC	3,984	190	—	—
	WEYERHAEUSER CO	11,541	422	3,261	127
	CROWN CASTLE INC	5,359	976	960	168
	IRON MOUNTAIN INC	5,455	281	—	—
	PROLOGIS INC	20,279	2,378	1,354	179
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,111	375	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,107	192	—	—
	DUKE REALTY CORP	3,277	202	24,944	1,229
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,047	309	—	—
	WELLTOWER INC	3,920	345	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,621	205	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,522	190	—	—



外国株式インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付		
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	25,074 (△67,508)	202 ( - )	- ( - )	- ( - )
		PUBLIC STORAGE	2,573	796	514	155
		REGENCY CENTERS CORP	1,319	80	-	-
		UDR INC	3,977	179	-	-
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	-	-	10,364	289
		DIGITAL REALTY TRUST INC	4,788	652	1,777	232
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,154	198	-	-
		WP CAREY INC	2,427	185	-	-
カ ナ ダ			口 千カナダ・ドル	口 千カナダ・ドル	口 千カナダ・ドル	口 千カナダ・ドル
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,199	179	-	-
オーストラリア		SCENTRE GROUP	75,111	205	-	-
		DEXUS/AU	48,116	453	22,768	244
		TRANSURBAN GROUP	28,586	402	-	-
		SYDNEY AIRPORT	15,879 (△78,065)	131 (△ 644)	- ( - )	- ( - )
		APA GROUP	28,695	314	8,621	97
		MIRVAC GROUP	51,566	105	-	-
		GOODMAN GROUP	19,950	438	-	-
香 港			口 千香港・ドル	口 千香港・ドル	口 千香港・ドル	口 千香港・ドル
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS LINK REIT	79,000 26,500	835 1,709	- -	- -
シンガポール			口 千シンガポール・ドル	口 千シンガポール・ドル	口 千シンガポール・ドル	口 千シンガポール・ドル
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	48,500 ( - )	146 (△ 7)	- ( - )	- ( - )
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	43,900 ( - )	96 (△ 0)	- ( - )	- ( - )
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	- ( - )	- (△ 6)	- ( - )	- ( - )
		CDL HOSPITALITY TRUSTS MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	- ( 4,102) -	- ( - ) (△ 0)	4,102 ( - ) -	4 ( - ) ( - )
イ ギ リ ス			口 千イギリス・ポンド	口 千イギリス・ポンド	口 千イギリス・ポンド	口 千イギリス・ポンド
		SEGR0 PLC BRITISH LAND CO PLC	10,208 17,444	105 92	- 13,398	- 64
ユ ー ロ	ベルギー フランス	WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,913	340	-	-
		GECINA SA	893	97	-	-
		KLEPIERRE	- ( - )	- (△ 23)	- ( - )	- ( - )

※金額は受渡し代金。

※( )内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国株式先物取引	百万円 133,121	百万円 121,473	百万円 —	百万円 —

※金額は受渡し代金。

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

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	93,114,424千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	371,314,612千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.25

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

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

外国株式インデックス・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2022年11月30日現在)

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株数	株数	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	58.89	72.44	1,034	143,673			ソフトウェア・サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	110.28	130.3	2,549	354,078			保険
ABBOTT LABORATORIES	957.32	1,108.13	11,635	1,615,803			ヘルスケア機器・サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	35.59	42.03	1,502	208,685			素材
VERISK ANALYTICS INC	79.29	96.74	1,711	237,692			商業・専門サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	23.71	28.44	1,162	161,446			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LAS VEGAS SANDS CORP	176.34	234.49	1,047	145,429			消費者サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	22.43	28.87	1,024	142,305			半導体・半導体製造装置
SVB FINANCIAL GROUP	31.11	37.27	816	113,414			銀行
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	339.4	382.49	2,582	358,694			ソフトウェア・サービス
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	14.69	17.45	2,709	376,267			消費者サービス
AFLAC INC	341.85	377.79	2,677	371,862			保険
DARDEN RESTAURANTS INC	76.06	76.06	1,102	153,113			消費者サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	222.02	260.21	2,596	360,594			食品・飲料・タバコ
ADOBE INC	257.02	302.05	9,870	1,370,701			ソフトウェア・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	120.02	140.2	1,491	207,156			素材
LULULEMON ATHLETICA INC	64.81	72.14	2,620	363,976			耐久消費財・アパレル
GARMIN LTD	84.44	107.74	967	134,372			耐久消費財・アパレル
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	118.18	136.78	4,133	573,979			素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	375.49	434.97	9,426	1,309,081			資本財
WR BERKLEY CORP	74.28	144.86	1,087	150,955			保険
AUTOZONE INC	11.37	12.12	3,097	430,209			小売
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	637.19	738.73	640	88,943			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DR HORTON INC	181.62	209.92	1,767	245,514			耐久消費財・アパレル
DENTSPLY SIRONA INC	118.64	118.64	358	49,772			ヘルスケア機器・サービス
AUTODESK INC	115.06	133.58	2,607	362,063			ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	121.01	166.41	916	127,263			公益事業
CITIGROUP INC	1,105.27	1,207.48	5,743	797,666			銀行
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	41.86	63.59	774	107,505			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	223.87	269.47	6,926	961,951			ソフトウェア・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	257.27	318.24	3,012	418,296			公益事業
HESS CORP	143.44	179.13	2,543	353,186			エネルギー
DAVITA INC	41.38	41.38	296	41,173			ヘルスケア機器・サービス
DOMINO'S PIZZA INC	21.21	21.21	812	112,827			消費者サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	307.81	353.37	3,722	516,929			各種金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	303.41	365.18	3,522	489,122			食品・飲料・タバコ
BUNGE LTD	71.74	102.63	1,068	148,451			食品・飲料・タバコ
TE CONNECTIVITY LTD	174.25	198.05	2,454	340,874			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	8,929.29	10,249.49	144,692	20,093,385			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	164.25	186.45	2,023	281,061			各種金融
BOEING CO/THE	301.3	353.54	6,198	860,752			資本財
CINCINNATI FINANCIAL CORP	78.58	105.1	1,136	157,818			保険
BECTON DICKINSON AND CO	151.4	184.31	4,442	616,893			ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	179.45	-	-	-			消費者サービス
NISOURCE INC	189.19	258.29	703	97,670			公益事業
ABBVIE INC	952.34	1,124.3	17,786	2,470,000			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,231.32	2,671.77	10,243	1,422,524			電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	712.57	814.17	25,656	3,562,979			各種金融
KINDER MORGAN INC	1,059.4	1,273.94	2,405	334,009			エネルギー
TRUIST FINANCIAL CORP	703.16	832.28	3,820	530,621			銀行
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,210.07	1,358.37	10,735	1,490,796			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価金額	価額	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	139.37	190.58	754	104,725	保険
CBOE GLOBAL MARKETS INC	56.61	73.23	902	125,338	各種金融
JPMORGAN CHASE & CO	1,618.84	1,865.39	25,473	3,537,541	銀行
T ROWE PRICE GROUP INC	123.14	136.63	1,646	228,634	各種金融
FAIR ISAAC CORP	14.94	14.94	882	122,561	ソフトウェア・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	21.07	28.88	658	91,448	資本財
CIGNA CORP	183.24	203.47	6,525	906,166	ヘルスケア機器・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	30.52	—	—	—	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	161.3	189.5	1,347	187,158	食品・飲料・タバコ
CADENCE DESIGN SYS INC	154	174.92	2,860	397,208	ソフトウェア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	65.01	71.31	2,313	321,326	各種金融
MERCADOLIBRE INC	24.57	28.89	2,569	356,767	小売
DOLLAR GENERAL CORP	127.46	142.55	3,604	500,539	小売
SERVICENOW INC	106.96	129.25	5,129	712,303	ソフトウェア・サービス
CATERPILLAR INC	297.38	340.65	8,009	1,112,260	資本財
BROWN & BROWN INC	142.73	142.73	818	113,692	保険
CHARLES RIVER LABORATORIES	25.77	34.67	830	115,310	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	305.28	366.96	3,097	430,202	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	456.88	517.62	1,729	240,157	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	44.11	55.3	994	138,100	運輸
MOSAIC CO/THE	185.84	213.06	1,080	150,098	素材
CISCO SYSTEMS INC	2,269.38	2,640.08	12,746	1,770,079	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MORGAN STANLEY	755.61	830.31	7,562	1,050,199	各種金融
BROADCOM INC	220.01	257.42	13,421	1,863,860	半導体・半導体製造装置
DELL TECHNOLOGIES -C	145.5	187.97	818	113,601	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DTE ENERGY COMPANY	105.36	120.57	1,376	191,094	公益事業
DOMINION ENERGY INC	443.47	526.1	3,144	436,676	公益事業
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	68.1	79.12	1,620	225,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DEERE & CO	157.22	185.94	8,199	1,138,650	資本財
VMWARE INC-CLASS A	106.05	138.09	1,629	226,340	ソフトウェア・サービス
BLACKSTONE INC	372.5	453.04	3,996	554,961	各種金融
NASDAQ INC	65.09	229.24	1,515	210,426	各種金融
ZOETIS INC	252.46	294.34	4,351	604,336	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONSOLIDATED EDISON INC	183.99	221.6	2,134	296,349	公益事業
KKR & CO INC	285.69	373.08	1,885	261,897	各種金融
COGNEX CORP	86.98	86.98	415	57,676	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALPHABET INC-CL C	156.03	3,569.93	34,071	4,731,496	メディア・娯楽
COLGATE-PALMOLIVE CO	430.41	500.68	3,803	528,215	家庭用品・パーソナル用品
HCA HEALTHCARE INC	143.12	145.75	3,436	477,286	ヘルスケア機器・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	192.52	226.62	5,864	814,462	ヘルスケア機器・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	139.31	171.44	1,454	201,985	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	238.46	281.36	14,882	2,066,777	食品・生活必需品小売り
CUMMINS INC	82.07	91.44	2,253	312,910	資本財
ACTIVISION BLIZZARD INC	400.92	506.81	3,767	523,210	メディア・娯楽
DELTA AIR LINES INC	82.99	82.99	287	39,887	運輸
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	69.25	87.26	851	118,269	運輸
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	95.42	118.11	2,044	283,933	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COTERRA ENERGY INC	402.61	499.08	1,400	194,545	エネルギー
TRANSIQM GROUP INC	26.81	33.74	2,057	285,757	資本財
MASIMO CORP	29.41	29.41	413	57,443	ヘルスケア機器・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	36.41	42.65	3,624	503,278	小売
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	378.73	462.12	1,898	263,629	食品・生活必需品小売り
SEAGEN INC	77.9	89.54	1,050	145,942	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COCA-COLA CO/THE	2,206.53	2,620.91	16,375	2,274,058	食品・飲料・タバコ
ENTEGRIS INC	—	99.61	721	100,135	半導体・半導体製造装置
EXPEDITORS INTL WASH INC	86.89	104.36	1,185	164,576	運輸

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
BURLINGTON STORES INC	33.91	48.02	924	128,362	小売
FRANKLIN RESOURCES INC	142.98	217.78	572	79,539	各種金融
CSX CORP	1,218.27	1,372.54	4,415	613,175	運輸
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	49.95	62.45	1,497	207,947	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDIA GROUP INC	80.61	100.81	1,032	143,424	消費者サービス
AMAZON.COM INC	242.97	5,804.71	53,647	7,449,976	小売
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	340.18	390.84	2,925	406,255	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	2,278.12	2,672.58	29,542	4,102,594	エネルギー
EVEREST RE GROUP LTD	20.65	27.55	916	127,324	保険
EOG RESOURCES INC	308.3	370.69	5,237	727,328	エネルギー
EQT CORP	—	192.98	823	114,325	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	83.21	103	937	130,205	ソフトウェア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	79.93	102.49	1,720	238,968	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	168.73	195.56	2,951	409,914	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FORD MOTOR CO	2,091.41	2,562.95	3,524	489,385	自動車・自動車部品
HORMEL FOODS CORP	149.39	194.75	938	130,329	食品・飲料・タバコ
LIBERTY GLOBAL PLC-A	84.32	84.32	166	23,091	電気通信サービス
KRAFT HEINZ CO/THE	384.38	441.24	1,722	239,217	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	102.41	117.21	1,724	239,499	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	175.57	221.16	1,783	247,696	公益事業
PAYPAL HOLDINGS INC	601.25	707.71	5,494	763,043	ソフトウェア・サービス
MSCI INC	43.83	50.79	2,470	343,011	各種金融
FORTINET INC	73.6	433.92	2,238	310,873	ソフトウェア・サービス
ALLY FINANCIAL INC	201.39	201.39	533	74,140	各種金融
ELEVANCE HEALTH INC	133.09	151.16	7,790	1,081,822	ヘルスケア機器・サービス
NEXTERA ENERGY INC	1,059.66	1,254.22	10,346	1,436,757	公益事業
PALO ALTO NETWORKS INC	53.93	186.42	3,178	441,418	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC	333.35	394.41	5,861	814,017	電気通信サービス
ELECTRONIC ARTS INC	153.52	183.78	2,344	325,629	メディア・娯楽
FREEPORT-MCMORAN INC	808.28	941.69	3,532	490,527	素材
SYNCHRONY FINANCIAL	321.12	321.12	1,197	166,246	各種金融
MARATHON PETROLEUM CORP	339.33	343.63	4,242	589,197	エネルギー
KEURIG DR PEPPER INC	382.44	469.03	1,787	248,161	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	746.23	913.39	4,072	565,590	銀行
AUTOLIV INC	40.01	—	—	—	自動車・自動車部品
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	638.81	861.38	1,331	184,932	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	29.09	39.21	587	81,578	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OLD DOMINION FREIGHT LINE	55.39	62.92	1,837	255,202	運輸
FASTENAL CO	298.92	370.51	1,862	258,652	資本財
FISERV INC	315.64	379.74	3,855	535,360	ソフトウェア・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	589.47	707.21	6,057	841,269	資本財
ALIGN TECHNOLOGY INC	41.54	49.14	942	130,906	ヘルスケア機器・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	25.22	30.07	968	134,453	ソフトウェア・サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	115.82	139.45	1,098	152,522	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	54.81	54.81	336	46,719	各種金融
TRANSUNION	94.97	112.33	679	94,313	商業・専門サービス
MATCH GROUP INC	137.29	177.99	834	115,875	メディア・娯楽
GODADDY INC - CLASS A	89.05	89.05	668	92,834	ソフトウェア・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	37.79	42.41	947	131,629	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO	689.43	871.13	3,462	480,870	自動車・自動車部品
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	110.49	1,621	225,154	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	71.66	71.66	471	65,420	資本財
HOLOGIC INC	135.92	165.91	1,233	171,347	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	126.42	148.67	3,734	518,663	資本財
GOLDMAN SACHS GROUP INC	181.67	219.77	8,432	1,171,062	各種金融
ALPHABET INC-CL A	161.11	3,806.93	36,238	5,032,394	メディア・娯楽

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	期	末		業種等
	株数	株数	評価金額	価額	
			外貨	邦貨	
			建金額	換算金額	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	42.03	42.03	548	76,198	ヘルスケア機器・サービス
WABTEC CORP	92.31	112.84	1,113	154,663	資本財
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	27.37	32.57	869	120,682	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIRST REPUBLIC BANK/CA	88.97	109.7	1,333	185,200	銀行
CELANESE CORP	55.98	66.43	701	97,371	素材
VAIL RESORTS INC	20.38	28.6	733	101,794	消費者サービス
MOLINA HEALTHCARE INC	34.28	34.28	1,106	153,629	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	70.02	72.56	2,795	388,223	メディア・娯楽
GENERAL MILLS INC	314.89	373.27	3,092	429,409	食品・飲料・タバコ
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	108.56	135.99	1,618	224,730	ヘルスケア機器・サービス
FIRSTENERGY CORP	269.48	319.66	1,272	176,676	公益事業
GENUINE PARTS CO	74.06	87.11	1,572	218,410	小売
FORTIVE CORP	183.73	219.81	1,441	200,244	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	371.5	424.45	1,528	212,196	銀行
XYLEM INC	91.24	122.01	1,340	186,175	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	110.79	119.65	2,699	374,868	資本財
LKQ CORP	159.22	159.22	842	117,032	小売
HALLIBURTON CO	443.17	548.52	2,038	283,058	エネルギー
TELADOC HEALTH INC	74.96	74.96	203	28,241	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	571.04	650.45	20,551	2,854,003	小売
ALBEMARLE CORP	65.6	74.33	2,007	278,720	素材
CDW CORP/DE	74.04	86.21	1,586	220,380	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	31.14	31.14	393	54,656	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	758.17	881.61	1,348	187,316	銀行
HERSHEY CO/THE	75.14	89.25	2,057	285,672	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	67.44	80.18	4,274	593,629	ヘルスケア機器・サービス
BLOCK INC	207.89	314.99	1,956	271,685	ソフトウェア・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	99.21	124.01	2,635	365,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPLUNK INC	82.52	97.92	743	103,196	ソフトウェア・サービス
S&P GLOBAL INC	127.67	217.47	7,549	1,048,364	各種金融
MARKETAXESS HOLDINGS INC	19.12	26.53	679	94,345	各種金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	207.99	303.66	1,268	176,225	銀行
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	41.41	41.41	178	24,767	メディア・娯楽
HP INC	653.88	697.11	2,013	279,580	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	39.15	49.71	924	128,331	ソフトウェア・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	471.43	563.97	8,261	1,147,287	ソフトウェア・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	76.75	83.42	1,521	211,348	ヘルスケア機器・サービス
SNAP INC - A	496.43	640.99	629	87,412	メディア・娯楽
TARGA RESOURCES CORP	-	123.5	910	126,433	エネルギー
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	57.07	107.72	1,091	151,610	メディア・娯楽
LEIDOS HOLDINGS INC	69.47	88.63	961	133,542	商業・専門サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	279.44	304.9	2,117	294,103	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	210.79	210.79	431	59,891	電気通信サービス
BLACK KNIGHT INC	76.23	106.56	647	89,897	ソフトウェア・サービス
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	79.4	79.4	435	60,412	運輸
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	81.95	-	-	-	保険
JUNIPER NETWORKS INC	174.6	174.6	556	77,274	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JM SMUCKER CO/THE	57.68	66.47	1,007	139,863	食品・飲料・タバコ
INGERSOLL-RAND INC	210.13	250.11	1,321	183,458	資本財
JOHNSON & JOHNSON	1,413.74	1,665.36	29,325	4,072,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ON SEMICONDUCTOR	209.12	278.91	1,972	273,914	半導体・半導体製造装置
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	26.34	33.19	965	134,055	半導体・半導体製造装置
HOWMET AEROSPACE INC	190.24	238.89	889	123,476	資本財
QORVO INC	60.42	60.42	567	78,854	半導体・半導体製造装置
IDEXX LABORATORIES INC	46.01	55.48	2,268	315,083	ヘルスケア機器・サービス
ARISTA NETWORKS INC	129.52	148.47	1,985	275,683	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
EXACT SCIENCES CORP	84.28	97.71	402	55,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EVERGY INC	112.73	133.33	774	107,519	公益事業
RINGCENTRAL INC-CLASS A	39.92	39.92	140	19,452	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	87.57	106.77	963	133,844	半導体・半導体製造装置
KIMBERLY-CLARK CORP	178	213.36	2,841	394,543	家庭用品・パーソナル用品
NORDSON CORP	28.84	28.84	665	92,435	資本財
KROGER CO	389.55	419.15	2,068	287,253	食品・生活必需品小売り
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	87.7	110.8	777	108,030	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	174.17	—	—	—	メディア・娯楽
POOL CORP	21.07	25.78	826	114,830	小売
CAESARS ENTERTAINMENT INC	106.9	133.36	651	90,505	消費者サービス
DOCUSIGN INC	100.78	120.31	536	74,448	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS B	87.73	87.73	262	36,476	メディア・娯楽
DOW INC	415.16	445.43	2,256	313,305	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	52.2	52.2	305	42,428	各種金融
CBRE GROUP INC - A	182.44	207.93	1,589	220,780	不動産
COUPA SOFTWARE INC	34.9	34.9	214	29,786	ソフトウェア・サービス
KLA CORP	81.57	94.74	3,546	492,488	半導体・半導体製造装置
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	110.98	139.27	982	136,485	ソフトウェア・サービス
COPART INC	109.77	275.84	1,777	246,843	商業・専門サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	61.17	70.72	1,548	215,087	小売
NRG ENERGY INC	135.47	135.47	567	78,844	公益事業
WARNER BROS DISCOVERY INC	70.75	—	—	—	メディア・娯楽
TWILIO INC - A	89.93	109.05	498	69,282	ソフトウェア・サービス
CORTEVA INC	393.48	444.4	2,913	404,657	素材
LOCKHEED MARTIN CORP	133.59	153.36	7,424	1,030,992	資本財
IDEX CORP	38.39	47.88	1,106	153,634	資本財
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12.88	12.88	346	48,157	保険
EPAM SYSTEMS INC	30.95	37.33	1,283	178,299	ソフトウェア・サービス
LENNOX INTERNATIONAL INC	15.27	21.04	548	76,209	資本財
EQUITABLE HOLDINGS INC	228.2	228.2	703	97,732	各種金融
CERNER CORP	155.37	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	153.31	181.57	1,812	251,717	ソフトウェア・サービス
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	—	49.92	1,197	166,314	各種金融
RESMED INC	75.95	87.75	1,958	271,988	ヘルスケア機器・サービス
BATH & BODY WORKS INC	154	154	612	85,094	小売
DATADOG INC - CLASS A	104.23	140.23	1,010	140,327	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	257.77	257.77	624	86,734	公益事業
GENERAC HOLDINGS INC	33	39.73	399	55,537	資本財
LOWE'S COS INC	377.98	400.32	8,305	1,153,376	小売
UNITED RENTALS INC	41.13	47.98	1,644	228,360	資本財
ELI LILLY & CO	439.37	511.14	18,602	2,583,390	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZENDESK INC	60.67	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	80.29	80.29	851	118,266	商業・専門サービス
LAM RESEARCH CORP	77.79	85.5	3,779	524,862	半導体・半導体製造装置
OKTA INC	63.06	103.37	529	73,569	ソフトウェア・サービス
CARVANA CO	38.03	—	—	—	小売
LOEWS CORP	127.27	127.27	735	102,120	保険
BIO-RAD LABORATORIES-A	12.2	12.2	487	67,692	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARKEL CORP	7.02	8.37	1,080	150,013	保険
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	98.74	130.21	1,796	249,535	ソフトウェア・サービス
GEN DIGITAL INC	313.47	417.79	945	131,237	ソフトウェア・サービス
ROLLINS INC	114.93	160.81	640	88,947	商業・専門サービス
ETSY INC	71.68	71.68	873	121,321	小売
DYNATRACE INC	95.87	95.87	348	48,447	ソフトウェア・サービス
LINCOLN NATIONAL CORP	86.77	86.77	330	45,897	保険



外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価金額	価額	
			外貨	邦貨換算金額	
PLUG POWER INC	285.84	285.84	425	59,144	資本財
MCDONALD'S CORP	402.64	468.04	12,703	1,764,075	消費者サービス
BILL. COM HOLDINGS INC	—	60.04	688	95,609	ソフトウェア・サービス
CABLE ONE INC	2.46	3.88	279	38,793	メディア・娯楽
3M CO	306.04	351.01	4,427	614,817	資本財
APOLLO ASSET MANAGEMENT INC	105.66	—	—	—	各種金融
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,284.02	1,451.52	15,888	2,206,413	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	72.93	83.02	2,518	349,777	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	44.7	59.08	1,421	197,423	ソフトウェア・サービス
COSTAR GROUP INC	205.4	251.16	1,965	272,924	商業・専門サービス
IAC INC	39.74	39.74	193	26,815	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	100.46	147.43	2,013	279,587	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	115.46	144.87	747	103,869	ソフトウェア・サービス
VIATRIS INC	630.72	834.66	933	129,586	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOORDASH INC - A	38.44	116.27	620	86,124	小売
ZSCALER INC	45.51	45.51	613	85,224	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	121.71	149.28	2,075	288,174	資本財
MODERNA INC	178.13	219.41	3,799	527,578	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLAR TREE INC	120.47	139.92	2,049	284,659	小売
PELOTON INTERACTIVE INC-A	125.99	—	—	—	耐久消費財・アパレル
FOX CORP - CLASS A	169.62	169.62	538	74,716	メディア・娯楽
PHILLIPS 66	224.92	312.8	3,408	473,349	エネルギー
ROBLOX CORP -CLASS A	—	227.45	678	94,220	メディア・娯楽
MGM RESORTS INTERNATIONAL	221.98	221.98	796	110,543	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	130.84	151.62	1,269	176,339	食品・飲料・タバコ
APA CORP	—	197.59	920	127,839	エネルギー
METLIFE INC	397.03	437.46	3,327	462,125	保険
MOTOROLA SOLUTIONS INC	92.12	106.92	2,827	392,669	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCKWELL AUTOMATION INC	62.19	70.31	1,825	253,501	資本財
MERCK & CO. INC.	1,364.93	1,609.11	17,513	2,432,107	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MASCO CORP	148.85	148.85	742	103,085	資本財
MARSH & MCLENNAN COS	266.25	317.65	5,358	744,082	保険
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	445.47	496.81	2,227	309,360	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	147.15	181.85	2,932	407,238	消費者サービス
WORKDAY INC-CLASS A	98.64	120.69	1,729	240,173	ソフトウェア・サービス
SUNRUN INC	106.69	—	—	—	資本財
BAKER HUGHES CO	374.18	609.81	1,747	242,620	エネルギー
AMERCO	6.5	—	—	—	運輸
MARVELL TECHNOLOGY INC	451.11	533.45	2,289	317,878	半導体・半導体製造装置
CHENIERE ENERGY INC	137.63	149.77	2,585	359,087	エネルギー
QUANTA SERVICES INC	—	88.91	1,285	178,474	資本財
NETAPP INC	109.19	132.73	952	132,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NIKE INC -CL B	687.23	811.97	8,627	1,198,056	耐久消費財・アパレル
NORFOLK SOUTHERN CORP	137.09	150.62	3,816	529,942	運輸
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	287.04	364.42	2,704	375,605	半導体・半導体製造装置
AFFIRM HOLDINGS INC	—	90.77	116	16,147	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	—	72.52	312	43,415	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	82.15	95.11	5,025	697,840	資本財
NEWMONT CORP	418.82	508.98	2,329	323,441	素材
MCKESSON CORP	84.11	94.17	3,595	499,268	ヘルスケア機器・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	843.16	990.61	9,687	1,345,258	食品・飲料・タバコ
NUCOR CORP	154.55	174.84	2,569	356,892	素材
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	276.58	276.58	205	28,537	メディア・娯楽
WESTERN UNION CO	218.4	218.4	316	43,886	ソフトウェア・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	—	193.54	558	77,539	自動車・自動車部品
NEWELL BRANDS INC	175.87	269.97	347	48,250	耐久消費財・アパレル



外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価金額	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	485.8	586.43	4,052	562,814	エネルギー
LUCID GROUP INC	—	217.3	212	29,452	自動車・自動車部品
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	242.07	1,594	221,363	各種金融
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	—	6.7	535	74,398	銀行
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	96	512	71,190	銀行
CONSTELLATION ENERGY	—	202.34	1,910	265,338	公益事業
WARNER BROS DISCOVERY INC	—	1,361.45	1,516	210,617	メディア・娯楽
APPROVIN CORP-CLASS A	—	89.26	119	16,659	ソフトウェア・サービス
ALCOA CORP	—	118.49	565	78,488	素材
CARLISLE COS INC	—	34.99	894	124,163	資本財
PAYCHEX INC	177.29	208.31	2,502	347,570	ソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	989.56	1,164.8	5,337	741,164	食品・飲料・タバコ
P G & E CORP	765.38	918.94	1,394	193,589	公益事業
PFIZER INC	3,012.01	3,564.55	17,640	2,449,799	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	292.37	335.65	2,310	320,921	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	66.91	80.47	2,368	328,865	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	121.84	145.47	3,502	486,409	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,315.39	1,518.47	22,090	3,067,735	家庭用品・パーソナル用品
EDELSON CORP	508.37	643.53	2,574	357,468	公益事業
NVR INC	1.73	1.73	788	109,501	耐久消費財・アパレル
CONOCOPHILLIPS	734.21	825.11	10,251	1,423,694	エネルギー
ABIOMED INC	22.88	27.31	1,030	143,103	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC	744.41	879.89	16,065	2,231,073	食品・飲料・タバコ
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	207.28	229.33	2,444	339,457	保険
ACCENTURE PLC-CL A	339.89	404.16	11,638	1,616,307	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	82.2	82.2	367	51,002	資本財
QUALCOMM INC	608.94	716.9	8,486	1,178,542	半導体・半導体製造装置
ADVANCE AUTO PARTS INC	34.26	34.26	506	70,380	小売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	141.24	164.09	1,474	204,720	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	54.95	68.37	5,032	698,874	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REPUBLIC SERVICES INC	114.15	142.32	1,944	270,074	商業・専門サービス
BOOKING HOLDINGS INC	22.31	26.17	5,278	733,081	消費者サービス
ROSS STORES INC	187.92	222.58	2,599	360,994	小売
PACKAGING CORP OF AMERICA	46.82	55.5	736	102,267	素材
QUEST DIAGNOSTICS INC	68.14	68.14	1,015	141,002	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTL INC	55.55	81.49	621	86,243	商業・専門サービス
RPM INTERNATIONAL INC	76.96	76.96	782	108,659	素材
PERKINELMER INC	56.24	83.23	1,112	154,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEICO CORP	18.88	30.85	483	67,076	資本財
HEICO CORP-CLASS A	45.7	45.7	559	77,698	資本財
REGIONS FINANCIAL CORP	470.41	629.79	1,442	200,368	銀行
TEXAS PACIFIC LAND CORP	—	4.17	1,045	145,141	エネルギー
AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	—	276.58	29	4,032	メディア・娯楽
CHEVRON CORP	1,041.57	1,181.31	21,385	2,969,770	エネルギー
JACOBS SOLUTIONS INC	—	84.22	1,033	143,587	商業・専門サービス
EDISON INTERNATIONAL	217.01	246.55	1,565	217,448	公益事業
IPG PHOTONICS CORP	17.76	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TESLA INC	438.7	1,671.95	30,233	4,198,577	自動車・自動車部品
AMERCO-NON VOTING	—	58.5	352	48,889	運輸
STANLEY BLACK & DECKER INC	91.29	91.29	734	102,066	資本財
SYNOPSYS INC	78.69	93.83	3,036	421,734	ソフトウェア・サービス
SOUTHERN CO/THE	556.86	685.72	4,507	625,920	公益事業
SYSCO CORP	268.62	311.26	2,648	367,798	食品・生活必需品小売り
TRAVELERS COS INC/THE	131.26	150.31	2,813	390,773	保険
SIGNATURE BANK	—	43.35	587	81,619	銀行
SCHLUMBERGER LTD	734.44	894.55	4,566	634,174	エネルギー

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
AT&T INC	3,854.89	4,577.81	8,702	1,208,504	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	70.76	70.76	277	38,568	運輸
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	136.16	151.87	3,668	509,475	素材
SEMPRA ENERGY	163.53	199	3,210	445,809	公益事業
TYLER TECHNOLOGIES INC	20.16	24.06	779	108,305	ソフトウェア・サービス
TEXAS INSTRUMENTS INC	498.76	588.9	10,186	1,414,639	半導体・半導体製造装置
SALESFORCE INC	522.57	635.19	9,634	1,337,951	ソフトウェア・サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	388.03	428.95	2,805	389,576	資本財
TERADYNE INC	85.42	106.42	949	131,809	半導体・半導体製造装置
UNION PACIFIC CORP	359.04	402.07	8,554	1,188,011	運輸
MARATHON OIL CORP	-	423.8	1,286	178,619	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	820.39	930.88	9,069	1,259,490	資本財
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	391.13	470.01	8,690	1,206,782	運輸
DEXCOM INC	50.47	248.41	2,742	380,809	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	147.6	169.37	1,477	205,192	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	506.62	593.75	31,350	4,353,574	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	52.27	64.25	1,252	173,951	ソフトウェア・サービス
VALERO ENERGY CORP	214.47	258.28	3,491	484,926	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	27.65	32.87	1,478	205,354	小売
WALT DISNEY CO/THE	976.83	1,161.43	10,997	1,527,234	メディア・娯楽
WELLS FARGO & CO	2,228.62	2,398.83	11,411	1,584,678	銀行
INSULET CORP	34	42.63	1,230	170,828	ヘルスケア機器・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	220.23	268.28	4,428	615,022	商業・専門サービス
WHIRLPOOL CORP	32.12	32.12	468	65,114	耐久消費財・アパレル
WALMART INC	833.65	964.31	14,751	2,048,478	食品・生活必需品小売り
WYNN RESORTS LTD	49.13	77.3	620	86,188	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	638.82	734.17	5,885	817,264	小売
WATERS CORP	34.25	40.95	1,352	187,752	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WASTE CONNECTIONS INC	135.56	161.22	2,270	315,276	商業・専門サービス
WESTERN DIGITAL CORP	148.57	184.92	666	92,524	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WEC ENERGY GROUP INC	164.38	197.74	1,917	266,308	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	272.31	330.85	1,928	267,814	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	908.92	1,041.54	21,774	3,023,815	ソフトウェア・サービス
PPL CORP	395.61	471.99	1,369	190,212	公益事業
PULTEGROUP INC	130.75	130.75	576	80,055	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	122.56	151.81	2,001	277,922	素材
NORTHERN TRUST CORP	110.23	130.26	1,195	165,986	各種金融
NVIDIA CORP	1,335.64	1,588.98	24,850	3,450,927	半導体・半導体製造装置
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	231.68	262.02	4,306	598,088	銀行
TYSON FOODS INC-CL A	149.49	197.31	1,311	182,075	食品・飲料・タバコ
NETFLIX INC	238.52	284.48	7,992	1,109,953	メディア・娯楽
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	211.63	247.75	13,372	1,857,012	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBE LIFE INC	43.33	63.73	747	103,812	保険
TEXTRON INC	118.03	148.7	1,045	145,231	資本財
NEWS CORP - CLASS A	231.02	231.02	428	59,543	メディア・娯楽
OMNICOM GROUP	104.17	125.45	988	137,209	メディア・娯楽
ORACLE CORP	1,012.06	1,003.64	8,114	1,126,850	ソフトウェア・サービス
MASTERCARD INC - A	475.6	549.61	18,858	2,618,917	ソフトウェア・サービス
LUMEN TECHNOLOGIES INC	497.58	497.58	272	37,797	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	56.57	66.85	2,842	394,779	ソフトウェア・サービス
YUM! BRANDS INC	155.49	180.46	2,274	315,862	消費者サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	96.29	96.29	528	73,437	食品・飲料・タバコ
BANK OF AMERICA CORP	4,143.47	4,589.12	16,979	2,357,977	銀行
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	90.8	115.57	1,122	155,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN EXPRESS CO	370.2	405.11	6,255	868,730	各種金融
ANALOG DEVICES INC	292.73	334.95	5,489	762,326	半導体・半導体製造装置

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ADVANCED MICRO DEVICES	656.29	1,013.83	7,440	1,033,262	半導体・半導体製造装置
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	447.45	505.66	3,106	431,437	保険
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	118.9	160.97	964	133,966	消費者サービス
AVERY DENNISON CORP	42.32	54.54	1,027	142,708	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	293.48	327.59	1,953	271,225	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	311.78	366.97	3,460	480,614	資本財
AMGEN INC	311.56	334.61	9,435	1,310,331	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EATON CORP PLC	213.26	250.62	4,063	564,340	資本財
CONSTELLATION BRANDS INC-A	88.81	104.39	2,647	367,692	食品・飲料・タバコ
APPLIED MATERIALS INC	496.83	539.08	5,566	772,950	半導体・半導体製造装置
CME GROUP INC	187.12	232.52	4,064	564,462	各種金融
ECOLAB INC	141.57	164.6	2,385	331,235	素材
EQUIFAX INC	68.41	79.22	1,496	207,836	商業・専門サービス
GILEAD SCIENCES INC	656.73	791.25	6,785	942,338	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STATE STREET CORP	186.94	240.45	1,777	246,861	各種金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	773	912.82	7,338	1,019,050	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	264.34	307.26	1,700	236,131	ヘルスケア機器・サービス
CAMPBELL SOUP CO	106.38	129.45	681	94,593	食品・飲料・タバコ
CROWN HOLDINGS INC	68.63	68.63	550	76,464	素材
CARDINAL HEALTH INC	151.14	180	1,415	196,598	ヘルスケア機器・サービス
FEDEX CORP	130.83	154.88	2,754	382,458	運輸
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	236.54	248.92	2,540	352,865	各種金融
FMC CORP	66.76	85.48	1,091	151,599	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	139.22	156.29	1,600	222,248	素材
CITRIX SYSTEMS INC	64.9	-	-	-	ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	2,177.38	2,618.39	7,567	1,050,849	半導体・半導体製造装置
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	196.26	260.27	892	124,009	メディア・娯楽
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	183.31	217.67	1,650	229,217	保険
ILLINOIS TOOL WORKS	168.69	196.22	4,402	611,387	資本財
SIRIUS XM HOLDINGS INC	676.56	565.5	362	50,338	メディア・娯楽
ILLUMINA INC	76.55	103.27	2,153	299,112	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	64	67.76	887	123,297	ソフトウェア・サービス
SNAP-ON INC	31.06	31.06	742	103,165	資本財
CARMAX INC	84.27	103.66	695	96,621	小売
DANAHER CORP	346.32	437.14	11,322	1,572,397	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DUKE ENERGY CORP	420.41	496.46	4,862	675,231	公益事業
TARGET CORP	268.17	293.11	4,876	677,195	小売
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	69.27	-	-	-	商業・専門サービス
CINTAS CORP	51.69	57.07	2,572	357,185	商業・専門サービス
CONAGRA BRANDS INC	246.39	308.96	1,141	158,577	食品・飲料・タバコ
CLOROX COMPANY	65.42	73.84	1,088	151,177	家庭用品・パーソナル用品
ENTERGY CORP	108.66	126.77	1,430	198,596	公益事業
MICROSOFT CORP	3,828.65	4,500.54	108,161	15,020,384	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	92.43	118.42	921	127,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CVS HEALTH CORP	693.53	821.13	8,283	1,150,337	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	726.98	842.2	6,441	894,481	ヘルスケア機器・サービス
MICRON TECHNOLOGY INC	612.23	722.06	3,979	552,701	半導体・半導体製造装置
BLACKROCK INC	82.52	95.88	6,845	950,680	各種金融
HASBRO INC	74.91	74.91	465	64,673	耐久消費財・アパレル
KEYCORP	511.28	627.41	1,165	161,797	銀行
KANSAS CITY SOUTHERN	48.66	-	-	-	運輸
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	751.11	889.48	5,875	815,863	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	27.71	27.71	851	118,305	ヘルスケア機器・サービス
CHUBB LTD	245.24	269.75	5,844	811,687	保険
ARROW ELECTRONICS INC	41.3	41.3	438	60,926	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALLSTATE CORP	164.19	180.7	2,410	334,701	保険

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
EBAY INC	355.51	355.51	1,556	216,091	小売
EASTMAN CHEMICAL CO	70.27	70.27	599	83,190	素材
XILINX INC	128.76	—	—	—	半導体・半導体製造装置
DISH NETWORK CORP-A	129.37	129.37	202	28,170	メディア・娯楽
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	124	142.45	3,061	425,194	家庭用品・パーソナル用品
TRIMBLE INC	127.59	155.66	877	121,895	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LENNAR CORP-A	144.94	171.26	1,479	205,484	耐久消費財・アパレル
LEAR CORP	37.36	37.36	523	72,712	自動車・自動車部品
STRYKER CORP	179.83	215.14	4,887	678,793	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	336.56	418.93	1,183	164,407	公益事業
PROGRESSIVE CORP	305.43	366.19	4,801	666,781	保険
AIRBNB INC-CLASS A	65.54	232.6	2,218	308,088	消費者サービス
ALLEGHANY CORP	6.89	—	—	—	保険
ALTICE USA INC- A	96.67	—	—	—	メディア・娯楽
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	35.39	48.66	681	94,576	保険
AMPHENOL CORP-CL A	313.96	378.96	2,933	407,326	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARAMARK	132.42	132.42	537	74,604	消費者サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	88.08	116.82	438	60,835	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	69.65	87.26	1,035	143,765	公益事業
AVALARA INC	43.19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	304.28	373.82	796	110,625	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PACCAR INC	180.41	218.97	2,282	317,037	資本財
BIO-TECHNE CORP	19.91	25.51	834	115,866	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CMS ENERGY CORP	169.96	169.96	1,023	142,086	公益事業
CARLYLE GROUP INC/THE	100.94	100.94	301	41,884	各種金融
CARRIER GLOBAL CORP	432.53	558.22	2,429	337,367	資本財
CATALENT INC	89.35	107.97	509	70,740	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTERPOINT ENERGY INC	320.03	370.91	1,134	157,512	公益事業
CERIDIAN HCM HOLDING INC	69.79	69.79	447	62,133	ソフトウェア・サービス
CHEWY INC - CLASS A	39.69	39.69	159	22,157	小売
CHURCH & DWIGHT CO INC	124.85	143.3	1,139	158,185	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	126.73	141.79	632	87,838	ソフトウェア・サービス
DEVON ENERGY CORP	361.96	401.69	2,711	376,533	エネルギー
DOVER CORP	82.25	89.29	1,244	172,814	資本財
DRAFTKINGS HOLDINGS INC	167.42	—	—	—	消費者サービス
DROPBOX INC-CLASS A	165.84	165.84	373	51,910	ソフトウェア・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	208.11	208.11	254	35,402	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ESSENTIAL UTILITIES INC	139.09	139.09	654	90,879	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	19.39	23.77	1,067	148,251	各種金融
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	43.71	43.71	831	115,451	ソフトウェア・サービス
GARTNER INC	45.68	53.57	1,821	252,994	ソフトウェア・サービス
WW GRAINGER INC	23.9	27.97	1,652	229,551	資本財
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	47.31	47.31	269	37,396	ソフトウェア・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	146.17	174.62	2,422	336,461	消費者サービス
HUBSPOT INC	22.75	25.61	723	100,534	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	191.4	234.72	852	118,419	素材
KELLOGG CO	129.49	158.43	1,147	159,288	食品・飲料・タバコ
LAMB WESTON HOLDINGS INC	74.17	—	—	—	食品・飲料・タバコ
LIBERTY BROADBAND-A	13.12	—	—	—	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	81.96	81.96	732	101,787	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	76.48	123.83	531	73,754	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	102.88	134.38	794	110,363	メディア・娯楽
LYFT INC-A	131.45	187.51	201	28,018	運輸
M & T BANK CORP	72.37	110.46	1,887	262,184	銀行
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	12.58	13.69	1,933	268,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONGODB INC	31.55	41.5	590	82,008	ソフトウェア・サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末			業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
MOODY'S CORP	92.47	105.11	3,043	422,616	各種金融	
BIOGEN INC	79.87	95.74	2,789	387,441	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVAVAX INC	36.01	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ONEOK INC	247.25	282.26	1,832	254,430	エネルギー	
OTIS WORLDWIDE CORP	211.11	253.48	1,948	270,623	資本財	
OWENS CORNING	52.05	52.05	466	64,786	資本財	
PPD INC	64.13	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	820.71	987.35	699	97,076	ソフトウェア・サービス	
PINNACLE WEST CAPITAL	59.96	—	—	—	公益事業	
PINTEREST INC- CLASS A	285.63	383	919	127,649	メディア・娯楽	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	96.39	115.2	1,329	184,566	各種金融	
ROKU INC	60.12	60.12	325	45,234	メディア・娯楽	
HENRY SCHEIN INC	75.59	75.59	609	84,607	ヘルスケア機器・サービス	
SEALED AIR CORP	78.95	78.95	410	57,044	素材	
SMITH (A.O.) CORP	71.57	71.57	432	60,120	資本財	
STEEL DYNAMICS INC	101.91	127.13	1,304	181,206	素材	
UNITY SOFTWARE INC	28.53	190.66	686	95,369	ソフトウェア・サービス	
10X GENOMICS INC-CLASS A	38.14	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
STARBUCKS CORP	638.21	734.09	7,242	1,005,770	消費者サービス	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	241	289.06	1,407	195,450	メディア・娯楽	
TWITTER INC	407.95	—	—	—	メディア・娯楽	
UGI CORP	105.88	152.56	577	80,167	公益事業	
UBER TECHNOLOGIES INC	671.87	962.42	2,671	371,015	運輸	
VOYA FINANCIAL INC	73.08	—	—	—	各種金融	
WAYFAIR INC- CLASS A	37.56	37.56	118	16,518	小売	
WESTLAKE CORP	—	21.89	234	32,578	素材	
WESTROCK CO	130.34	167.66	615	85,494	素材	
PTC INC	54.62	72.95	897	124,676	ソフトウェア・サービス	
WILLIAMS COS INC	648.02	755.29	2,592	359,972	エネルギー	
ZILLOW GROUP INC - A	31.54	—	—	—	不動産	
ZILLOW GROUP INC - C	79.06	106.72	376	52,330	不動産	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	—	153.82	408	56,670	メディア・娯楽	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	4.67	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
OAK STREET HEALTH INC	62.12	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
INTUIT INC	147.65	171.98	6,530	906,856	ソフトウェア・サービス	
BORGWARNER INC	120.75	174.33	730	101,509	自動車・自動車部品	
BEST BUY CO INC	121.32	121.32	1,021	141,790	小売	
BALL CORP	171.66	194.1	1,062	147,549	素材	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	745.56	896.31	3,988	553,894	ヘルスケア機器・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	75.55	87.62	1,563	217,134	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	135.3	161.59	5,111	709,844	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VF CORP	171.17	205.83	668	92,782	耐久消費財・アパレル	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	323.81	409.64	809	112,351	メディア・娯楽	
MOHAWK INDUSTRIES INC	28.63	28.63	288	40,132	耐久消費財・アパレル	
CARNIVAL CORP	481.56	697.45	680	94,433	消費者サービス	
CLEVELAND-CLIFFS INC	—	334.03	505	70,229	素材	
COMCAST CORP-CLASS A	2,468.63	2,796.7	9,922	1,377,964	メディア・娯楽	
APTIV PLC	141.47	174.16	1,774	246,402	自動車・自動車部品	
STERIS PLC	52.82	62.71	1,118	155,351	ヘルスケア機器・サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	68.23	68.23	1,627	225,981	保険	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	122.53	132.6	683	94,961	食品・飲料・タバコ	
LINDE PLC	280.91	320.85	10,651	1,479,140	素材	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	74.31	207.85	895	124,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	76	76	334	46,438	資本財	
NXP SEMICONDUCTORS NV	144.57	165.94	2,732	379,513	半導体・半導体製造装置	
AERCAP HOLDINGS NV	—	87.8	528	73,449	資本財	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株数	金額	株数	金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
SEA LTD-ADR	37.25		247.19		1,341	186,259	メディア・娯楽
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	—		966.61		273	37,987	運輸
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	115		116		563	78,289	資本財
TELEFLEX INC	23.4		30.67		693	96,320	ヘルスケア機器・サービス
WIX.COM LTD	31.94		31.94		270	37,502	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	20.55		23		347	48,194	ソフトウェア・サービス
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	—		62.49		133	18,588	運輸
ALLEGION PLC	47.64		47.64		527	73,282	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	204.76		253.2		1,493	207,384	保険
TRANE TECHNOLOGIES PLC	127.59		143.63		2,513	349,033	資本財
NOVOCURE LTD	45.17		69.29		517	71,859	ヘルスケア機器・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	118		118		607	84,309	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	26.04		40.89		636	88,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	523		791		314	43,718	不動産
AMCOR PLC	823.02		976.1		1,182	164,152	素材
AON PLC-CLASS A	120.05		131.51		3,981	552,869	保険
IHS MARKIT LTD	195.84		—		—	—	商業・専門サービス
INVESCO LTD	183.28		183.28		345	47,951	各種金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	31.59		53.75		314	43,665	各種金融
CLARIVATE PLC	199.39		199.39		182	25,391	商業・専門サービス
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	168,148.91 598銘柄	215,606.3 597銘柄	2,163,247 —	300,410,237 <67.9%>	
(カナダ)					千カナダ・ドル		
IMPERIAL OIL LTD	129.99		162.67		1,268	129,590	エネルギー
METRO INC/CN	131.09		147.65		1,149	117,428	食品・生活必需品小売り
HYDRO ONE LTD	188.21		188.21		689	70,392	公益事業
TECK RESOURCES LTD-CLS B	248.14		298.36		1,432	146,336	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC	170.08		—		—	—	資本財
WEST FRASER TIMBER CO LTD	44.38		44.38		480	49,051	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC	10.26		13.38		2,821	288,283	ソフトウェア・サービス
WSP GLOBAL INC	61.41		76.68		1,228	125,455	資本財
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	133.85		—		—	—	素材
ATCO LTD -CLASS I	30.3		—		—	—	公益事業
AIR CANADA	120.83		120.83		228	23,354	運輸
NUTRIEN LTD	298.98		340.81		3,778	386,017	素材
QUEBECOR INC -CL B	99.53		145.78		421	43,085	メディア・娯楽
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	313.59		441.54		437	44,701	公益事業
LUNDIN MINING CORP	464.46		464.46		382	39,098	素材
ALTAGAS LTD	173.47		173.47		388	39,732	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	—		50.97		723	73,909	運輸
TOURMALINE OIL CORP	—		204.01		1,654	169,025	エネルギー
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	—		529.06		3,240	331,048	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	243.35		310.91		1,593	162,814	素材
ARC RESOURCES LTD	—		449.23		870	88,895	エネルギー
BRP INC/CA- SUB VOTING	—		30.82		299	30,575	耐久消費財・アパレル
INTACT FINANCIAL CORP	100.95		114.16		2,275	232,435	保険
BCE INC	55.09		55.09		352	36,024	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	101.65		127.89		2,465	251,871	素材
SUNCOR ENERGY INC	786.42		932.93		4,238	432,984	エネルギー
NATIONAL BANK OF CANADA	169.93		225.33		2,217	226,560	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	633.07		742.87		5,175	528,736	銀行
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	235.13		589.41		3,783	386,514	銀行
TORONTO-DOMINION BANK	984.88		1,164.32		10,431	1,065,645	銀行
ROYAL BANK OF CANADA	770.35		905.61		12,114	1,237,601	銀行
TC ENERGY CORP	539.18		618.97		3,791	387,371	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	930.98		1,147.92		2,477	253,071	素材



外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
THOMSON REUTERS CORP	97.1	113.7	1,753	179,112	商業・専門サービス
EMPIRE CO LTD 'A	91.48	91.48	334	34,186	食品・生活必需品小売り
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	182.36	225.95	1,386	141,683	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	134.47	272.43	1,845	188,585	素材
KINROSS GOLD CORP	635.01	635.01	347	35,485	素材
BANK OF MONTREAL	354.24	425.03	5,548	566,818	銀行
CAMECO CORP	188.9	266.27	842	86,094	エネルギー
TELUS CORP	152.22	152.22	434	44,413	電気通信サービス
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	30.01	30.01	446	45,650	小売
IVANHOE MINES LTD-CL A	326.98	326.98	374	38,281	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	643.74	723.31	5,837	596,393	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	13.93	13.93	1,094	111,854	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	163.31	189.21	1,548	158,194	自動車・自動車部品
WESTON (GEORGE) LTD	35.78	49.84	846	86,486	食品・生活必需品小売り
PAN AMERICAN SILVER CORP	117.63	117.63	243	24,923	素材
BLACKBERRY LTD	259.93	486.54	318	32,556	ソフトウェア・サービス
ENBRIDGE INC	1,077.03	1,275.5	7,081	723,453	エネルギー
MANULIFE FINANCIAL CORP	998.1	1,214.16	2,907	297,072	保険
BAUSCH HEALTH COS INC	164.47	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	347.38	581.52	6,333	647,072	運輸
GILDAN ACTIVEWEAR INC	90.66	113.02	431	44,071	耐久消費財・アパレル
CGI INC	114.93	134.76	1,558	159,188	ソフトウェア・サービス
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	272.32	311.75	1,144	116,947	メディア・娯楽
IGM FINANCIAL INC	49.49	49.49	192	19,621	各種金融
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	316.72	414.52	1,298	132,631	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	442.7	-	-	-	食品・生活必需品小売り
YAMANA GOLD INC	535.88	-	-	-	素材
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	56.67	79.3	573	58,629	商業・専門サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	694.48	881.4	5,381	549,807	各種金融
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	63.36	63.36	270	27,587	公益事業
B2GOLD CORP	429.63	-	-	-	素材
CAE INC	128.91	179.63	515	52,667	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B	87.05	87.05	559	57,119	素材
CANADIAN NATL RAILWAY CO	386.87	364.38	6,194	632,788	運輸
CANADIAN UTILITIES LTD-A	73.44	73.44	266	27,249	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	112.51	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENOVUS ENERGY INC	750.6	856.69	2,371	242,253	エネルギー
DOLLARAMA INC	170.25	170.25	1,386	141,646	小売
EMERA INC	142.79	180	928	94,849	公益事業
FIRSTSERVICE CORP	25.16	25.16	426	43,613	不動産
FORTIS INC	241.71	301.71	1,612	164,747	公益事業
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	99.13	99.13	378	38,705	商業・専門サービス
GREAT-WEST LIFE CO INC	142	142	454	46,479	保険
IA FINANCIAL CORP INC	48.51	82.68	624	63,805	保険
KEYERA CORP	113.74	113.74	345	35,335	エネルギー
LIGHTSPEED COMMERCE INC	63.63	63.63	132	13,514	ソフトウェア・サービス
LOBLAW COMPANIES LTD	86.83	115.73	1,403	143,365	食品・生活必需品小売り
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC	30.84	50.42	195	19,990	ソフトウェア・サービス
NORTHLAND POWER INC	108.7	157.41	592	60,528	公益事業
ONEX CORPORATION	42.17	42.17	290	29,656	各種金融
OPEN TEXT CORP	136.65	153.37	604	61,748	ソフトウェア・サービス
PARKLAND CORP	76.66	76.66	214	21,928	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	321.72	373.48	1,804	184,363	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	317.68	317.68	1,063	108,656	保険
RESTAURANT BRANDS INTERN	145.1	192.7	1,701	173,809	消費者サービス
SAPUTO INC	134.25	134.25	433	44,244	食品・飲料・タバコ

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等
		株数	評価額	評価額	
		株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
SHOPIFY INC - CLASS A	60.82	709.5	3,579	365,674	ソフトウェア・サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	305.5	370.83	2,323	237,418	保険
TMX GROUP LTD	31.42	31.42	434	44,360	各種金融
TOROMOUNT INDUSTRIES LTD	38.43	60.27	613	62,686	資本財
小計	株数 21,673.53 銘柄数 88銘柄	25,581.42 85銘柄	154,244	15,757,631	
				<3.6%>	
<b>(オーストラリア)</b>					
AURIZON HOLDINGS LTD	944.4	1,302.51	487	45,201	運輸
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	57.83	—	—	—	各種金融
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	658.44	658.44	693	64,395	素材
BHP GROUP LTD	1,575.18	3,236.91	14,507	1,346,181	素材
REA GROUP LTD	28.33	28.33	347	32,267	メディア・娯楽
AUSNET SERVICES	1,377.72	—	—	—	公益事業
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	37.94	37.94	248	23,094	消費者サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,287.24	1,287.24	374	34,757	保険
SOUTH32 LTD	2,763.48	2,763.48	1,124	104,364	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	503.54	1,194.9	4,400	408,351	エネルギー
IDP EDUCATION LTD	—	109.4	322	29,895	消費者サービス
WISETECH GLOBAL LTD	79.09	106.21	590	54,765	ソフトウェア・サービス
XERO LTD	74.59	86.83	603	55,995	ソフトウェア・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	140.25	127.22	354	32,923	エネルギー
AFTERPAY LTD	114.91	—	—	—	ソフトウェア・サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	884.48	1,052	2,047	189,958	素材
COLES GROUP LTD	735.52	847.99	1,446	134,236	食品・生活必需品小売り
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	656.07	893.18	628	58,346	食品・生活必需品小売り
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,731.85	2,073.67	6,571	609,765	銀行
LOTTERY CORP LTD/THE	—	1,397.85	637	59,146	消費者サービス
WESTPAC BANKING CORP	2,017.31	2,273.53	5,417	502,719	銀行
TELSTRA GROUP LTD	—	2,733.43	1,093	101,453	電気通信サービス
SANTOS LTD	1,003.76	2,138.11	1,567	145,423	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,480.02	1,832.88	4,565	423,651	銀行
RIO TINTO LTD	193.36	227.51	2,453	227,636	素材
ORIGIN ENERGY LTD	880.6	1,109.98	884	82,087	公益事業
EVOLUTION MINING LTD	844.2	844.2	225	20,914	素材
OIL SEARCH LTD	1,056.18	—	—	—	エネルギー
SEEK LTD	172.66	219.57	488	45,291	メディア・娯楽
AGL ENERGY LTD	324.92	—	—	—	公益事業
TREASURY WINE ESTATES LTD	364.64	456.84	624	57,904	食品・飲料・タバコ
NEWCREST MINING LTD	421.31	540.82	1,061	98,508	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	960.41	1,070.36	11,569	1,073,535	銀行
AMPOL LTD	109.27	144.28	411	38,168	エネルギー
ORICA LTD	179.81	362.12	542	50,300	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	808.63	1,018.6	1,320	122,492	保険
WOOLWORTHS GROUP LTD	656.07	747.6	2,615	242,724	食品・生活必需品小売り
TABCORP HOLDINGS LTD	1,128.17	—	—	—	消費者サービス
CROWN RESORTS LTD	218.63	—	—	—	消費者サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	458.31	782.26	484	44,930	運輸
TELSTRA CORP LTD	2,169.43	—	—	—	電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	261.08	261.08	767	71,223	素材
MACQUARIE GROUP LTD	189.53	226.04	4,023	373,341	各種金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	307.49	377.19	1,337	124,073	消費者サービス
CSL LTD	247.47	304.42	9,211	854,701	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESFARMERS LTD	606.28	732.5	3,542	328,696	小売
COCHLEAR LTD	33.68	40.95	865	80,334	ヘルスケア機器・サービス
BLUESCOPE STEEL LTD	254.62	372.14	636	59,082	素材
SUNCORP GROUP LTD	639.33	882.34	1,058	98,246	保険



外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等
		株数	評価額	評価額	
		株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
ASX LTD	111.8	111.8	775	71,922	各種金融
COMPUTERSHARE LTD	335.63	287.38	794	73,758	ソフトウェア・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,171.87	1,737.55	834	77,389	保険
SONIC HEALTHCARE LTD	242.58	311.26	986	91,497	ヘルスケア機器・サービス
BRAMBLES LTD	746.38	860.89	1,034	96,018	商業・専門サービス
MINERAL RESOURCES LTD	—	116.62	976	90,648	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	94.46	107.81	705	65,464	ヘルスケア機器・サービス
REECE LTD	193.09	130.59	202	18,782	資本財
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	98,465 —	9,136,574 < 2.1% >	
(香港)			千香港・ドル		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	715	915	3,660	65,074	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,180	1,490	6,801	120,936	消費者サービス
MTR CORP	845	845	3,147	55,964	運輸
SUN HUNG KAI PROPERTIES	680	890	8,250	146,690	不動産
SINO LAND CO	2,482	2,482	2,479	44,085	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	270	270	1,625	28,899	不動産
CLP HOLDINGS LTD	851	941	5,316	94,530	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	833.84	833.84	2,026	36,026	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	6,063.89	7,223.89	4,767	84,770	公益事業
HANG SENG BANK LTD	388	482	5,755	102,325	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	848.33	848.33	1,571	27,934	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,539.24	1,734.24	7,674	136,443	資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,029.24	1,269.24	5,984	106,403	不動産
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	629	738	22,140	393,649	各種金融
WH GROUP LTD	5,815	5,610	2,524	44,885	食品・飲料・タバコ
HANG LUNG PROPERTIES LTD	980	980	1,319	23,453	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	940	940	1,351	24,033	資本財
SJM HOLDINGS LTD	800	—	—	—	消費者サービス
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	896	896	1,908	33,932	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	910	1,250	4,506	80,121	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD	530	530	931	16,566	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	300	410	1,594	28,357	公益事業
AIA GROUP LTD	6,540	7,632	58,155	1,034,010	保険
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	700	700	1,066	18,967	運輸
SANDS CHINA LTD	1,160	1,424	2,830	50,333	消費者サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,170	1,170	1,581	28,125	小売
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	705	830	7,378	131,193	資本財
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,875	2,470	6,162	109,571	銀行
WYNN MACAU LTD	708	—	—	—	消費者サービス
ESR GROUP LTD	1,020	1,570	2,615	46,505	不動産
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	175,129 —	3,113,794 < 0.7% >	
(シンガポール)			千シンガポール・ドル		
UNITED OVERSEAS BANK LTD	647	756	2,328	235,269	銀行
DBS GROUP HOLDINGS LTD	966	1,098	3,837	387,742	銀行
SINGAPORE AIRLINES LTD	779.66	779.66	426	43,090	運輸
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,366	1,762	646	65,337	不動産
KEPPEL CORP LTD	547	944	710	71,822	資本財
UOL GROUP LTD	172	309	200	20,262	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	258	258	213	21,532	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,812	2,114	2,615	264,221	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	3,275	3,275	286	28,954	消費者サービス
VENTURE CORP LTD	87	217	375	37,931	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,398.15	4,807.15	1,312	132,600	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,086	1,086	379	38,295	資本財

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期		末		業種等
		期首(前期末)	期	評価額	価額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
SINGAPORE EXCHANGE LTD	428	652	595	60,212	各種金融	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,032	1,300	531	53,722	食品・飲料・タバコ	
小計	16,853.81	19,357.81	14,459	1,460,996		
(ニュージーランド)	14銘柄	14銘柄	—	< 0.3% >		
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,114.59	990.68	512	44,156	電気通信サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	884.45	664.54	314	27,130	公益事業	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	707.11	788.08	616	53,080	運輸	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	312.5	390.17	889	76,653	ヘルスケア機器・サービス	
RYMAN HEALTHCARE LTD	240.28	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
A2 MILK CO LTD	347.17	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
MERCURY NZ LTD	269.13	625.22	327	28,244	公益事業	
小計	3,875.23	3,458.69	2,661	229,265		
(イギリス)	7銘柄	5銘柄	—	< 0.1% >		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	632.89	—	—	—	保険	
BP PLC	10,791.42	12,227.97	6,016	1,000,066	エネルギー	
ASHTAD GROUP PLC	236.86	261.31	1,304	216,796	資本財	
UNILEVER PLC	1,418.83	1,633.79	6,738	1,120,151	家庭用品・パーソナル用品	
NMC HEALTH PLC	39.4	39.4	0	6	ヘルスケア機器・サービス	
JD SPORTS FASHION PLC	288.6	1,443	179	29,839	小売	
BHP GROUP PLC	1,164.84	—	—	—	素材	
AUTO TRADER GROUP PLC	439.54	513.19	289	48,181	メディア・娯楽	
AVEVA GROUP PLC	60.37	60.37	191	31,872	ソフトウェア・サービス	
BARCLAYS PLC	9,047.41	10,831.54	1,743	289,884	銀行	
SHELL PLC	—	4,729.35	11,352	1,887,176	エネルギー	
HALEON PLC	—	2,935.73	837	139,228	家庭用品・パーソナル用品	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,941.44	4,941.44	440	73,188	資本財	
PRUDENTIAL PLC	1,434.05	1,780.81	1,718	285,603	保険	
NATWEST GROUP PLC	3,162.87	3,474.2	905	150,442	銀行	
EVRAZ PLC	282.75	—	—	—	素材	
JOHNSON MATTHEY PLC	100.74	100.74	215	35,786	素材	
BAE SYSTEMS PLC	1,657.53	2,092.6	1,695	281,899	資本財	
AVIVA PLC	1,986.01	1,740.6	780	129,797	保険	
GSK PLC	2,665.28	2,574.03	3,649	606,649	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RELX PLC	1,062.84	1,214.21	2,780	462,209	商業・専門サービス	
DIAGEO PLC	1,268.68	1,457.4	5,491	912,849	食品・飲料・タバコ	
RIO TINTO PLC	611.3	726.7	4,042	672,006	素材	
STANDARD CHARTERED PLC	1,465.61	1,518.95	925	153,769	銀行	
TESCO PLC	3,999.3	4,959.19	1,155	192,077	食品・生活必需品小売り	
PEARSON PLC	396.23	396.23	389	64,811	メディア・娯楽	
NEXT PLC	68.6	90.3	518	86,160	小売	
TAYLOR WIMPEY PLC	2,255.88	2,255.88	230	38,286	耐久消費財・アパレル	
BUNZL PLC	170.64	226.58	694	115,479	資本財	
VODAFONE GROUP PLC	15,460.57	16,395.44	1,505	250,193	電気通信サービス	
KINGFISHER PLC	1,096.78	1,096.78	264	43,902	小売	
WPP PLC	639.87	785.03	681	113,322	メディア・娯楽	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	332.07	420.35	431	71,691	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	124.18	149.04	404	67,239	公益事業	
RENTOKIL INITIAL PLC	905.52	1,568.48	840	139,646	商業・専門サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	373.85	449.2	2,668	443,542	家庭用品・パーソナル用品	
SSE PLC	558.79	705.32	1,182	196,503	公益事業	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	647.66	647.66	257	42,859	耐久消費財・アパレル	
ASTRAZENECA PLC	835.63	980.93	10,849	1,803,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,136.37	3,863.91	982	163,400	保険	
3I GROUP PLC	493.38	608.07	815	135,497	各種金融	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等		
	株数	株数	評価額	価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額			
SAGE GROUP PLC/THE	559.87	750.45	589	98,051	ソフトウェア・サービス		
NATIONAL GRID PLC	1,918.51	2,243.29	2,262	376,071	公益事業		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	38,170.21	43,247.26	2,002	332,850	銀行		
IMPERIAL BRANDS PLC	500.03	594.22	1,261	209,703	食品・飲料・タバコ		
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	66.37	66.37	251	41,736	耐久消費財・アパレル		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,143.93	1,385.71	4,642	771,776	食品・飲料・タバコ		
HSBC HOLDINGS PLC	11,079.75	12,552.33	6,405	1,064,778	銀行		
ANGLO AMERICAN PLC	669.35	803.77	2,644	439,512	素材		
COMPASS GROUP PLC	930.18	1,100.16	2,013	334,761	消費者サービス		
PERSIMMON PLC	169.16	169.16	214	35,711	耐久消費財・アパレル		
SAINSBURY (J) PLC	1,134.8	1,134.8	253	42,085	食品・生活必需品小売り		
BT GROUP PLC	4,699.07	4,039.57	496	82,459	電気通信サービス		
BURBERRY GROUP PLC	190.12	262.33	561	93,319	耐久消費財・アパレル		
SMITH & NEPHEW PLC	443.55	572.78	617	102,639	ヘルスケア機器・サービス		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	177.16	213.45	1,716	285,415	各種金融		
SHELL PLC	2,192.98	—	—	—	エネルギー		
SHELL PLC	1,991.91	—	—	—	エネルギー		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	75.81	145.9	218	36,294	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ADMIRAL GROUP PLC	115.35	115.35	233	38,866	保険		
ANTOFAGASTA PLC	194.39	194.39	265	44,075	素材		
ABRDN PLC	1,232.63	1,380.15	283	47,077	各種金融		
EXPERIAN PLC	488.95	547.49	1,570	261,105	商業・専門サービス		
SCHRODERS PLC	62.13	617.11	278	46,244	各種金融		
HALMA PLC	198.39	243.75	518	86,223	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	167.71	242.58	384	63,913	食品・飲料・タバコ		
ST JAMES' S PLACE PLC	261.57	338.23	390	64,854	各種金融		
INTERTEK GROUP PLC	81.84	118.84	468	77,912	商業・専門サービス		
MONDI PLC	251.28	339.05	527	87,696	素材		
WHITBREAD PLC	112.82	112.82	291	48,498	消費者サービス		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	195.72	310.08	263	43,843	各種金融		
SMITHS GROUP PLC	243.69	243.69	388	64,651	資本財		
OCADO GROUP PLC	273.79	273.79	168	28,080	食品・生活必需品小売り		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	368.51	592.86	353	58,736	保険		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	95.87	118.2	560	93,231	消費者サービス		
CRODA INTERNATIONAL PLC	78.38	78.38	526	87,451	素材		
M&G PLC	1,330.64	1,197.33	230	38,253	各種金融		
INFORMA PLC	781.52	1,027.55	627	104,262	メディア・娯楽		
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	36.85	44.59	499	83,090	資本財		
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,217.14	3,052.27	401	66,669	資本財		
GLENCORE PLC	5,395.65	6,227.41	3,430	570,178	素材		
COCA-COLA HBC AG-DI	87.04	87.04	175	29,197	食品・飲料・タバコ		
DCC PLC	59.54	59.54	266	44,290	資本財		
ENTAIN PLC	288.65	421.58	589	97,935	消費者サービス		
FERGUSON PLC	120.17	133.61	1,267	210,772	資本財		
小計	株数	金額	157,107.16	179,294.95	116,283	19,329,750	
	銘柄数	<比率>	83銘柄	80銘柄	—	<4.4%>	
(イスラエル)					イスラエル・シユケル		
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	—	74.38	1,126	45,450	半導体・半導体製造装置		
BANK HAPUALIM BM	664.03	846.82	2,793	112,679	銀行		
BANK LEUMI LE-ISRAEL	701.5	926.39	2,916	117,625	銀行		
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	546.74	853.39	1,745	70,390	銀行		
NICE LTD	32.51	39.19	2,550	102,887	ソフトウェア・サービス		
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	92.49	92.49	1,173	47,339	銀行		
AZRIELI GROUP LTD	21.4	21.4	520	20,974	不動産		
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	—	1,795.69	1,123	45,303	電気通信サービス		
ICL GROUP LTD	287.11	417.73	1,193	48,153	素材		

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	金額	期		末		業種等
			株数	金額	評価額	金額	
小計	株数	金額	株数	金額	評価額	金額	
ELBIT SYSTEMS LTD	13.89		13.89		803	32,404	資本財
小計	2,359.67		5,081.37		15,947	643,208	
(スイス)	8銘柄		10銘柄		—	<0.1%>	
UBS GROUP AG-REG	1,911.89		2,212.55		3,838	559,194	各種金融
JULIUS BAER GROUP LTD	125.5		151.68		818	119,181	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	21.32		30.3		543	79,139	資本財
HOLCIM LTD	272.39		352.46		1,724	251,220	素材
SWISS PRIME SITE-REG	39.06		55.72		436	63,554	不動産
VIFOR PHARMA AG	26.38		—		—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.59		0.72		702	102,365	食品・飲料・タバコ
ADECCO GROUP AG-REG	91.18		91.18		295	43,074	商業・専門サービス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.05		0.06		584	85,129	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	12.03		13.72		1,246	181,552	各種金融
SCHINDLER HOLDING AG-REG	9.41		17.66		301	43,938	資本財
SIKA AG-REG	78		92.91		2,162	315,076	素材
ALCON INC	265.85		311.65		1,999	291,273	ヘルスケア機器・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	15.7		—		—	—	銀行
ROCHE HOLDING AG-BR	19.21		17.4		648	94,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	25.16		52.25		238	34,813	耐久消費財・アパレル
BACHEM HOLDING AG	—		17.56		154	22,433	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VAT GROUP AG	—		14.36		370	53,927	資本財
SIG GROUP AG	—		222.69		446	65,073	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG-RTS	—		1,681.96		16	2,425	各種金融
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	377.96		445.08		13,764	2,005,016	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD-REG	908.36		1,037.2		3,052	444,654	資本財
SWISS RE AG	151.68		192.28		1,625	236,735	保険
NESTLE SA-REG	1,547.36		1,789.46		19,909	2,900,221	食品・飲料・タバコ
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,454.88		1,681.96		488	71,102	各種金融
SGS SA-REG	3.08		3.74		817	119,040	商業・専門サービス
SWATCH GROUP AG/THE-BR	17.16		17.16		421	61,367	耐久消費財・アパレル
BALOISE HOLDING AG - REG	24.75		24.75		352	51,303	保険
CLARIANT AG-REG	101.01		101.01		157	22,939	素材
NOVARTIS AG-REG	1,195.88		1,379.72		11,493	1,674,195	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	283.58		327.7		3,930	572,594	耐久消費財・アパレル
SWISSCOM AG-REG	13.99		17.09		862	125,669	電気通信サービス
GIVAUDAN-REG	4.84		5.68		1,775	258,646	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	80.94		97.13		4,390	639,531	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG	5.31		70.44		743	108,253	ヘルスケア機器・サービス
SONOVA HOLDING AG-REG	26.6		32.69		790	115,144	ヘルスケア機器・サービス
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	81.5		104.26		578	84,260	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG-REG	39.84		47.15		2,292	334,007	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEMENOS AG - REG	37.43		37.43		214	31,242	ソフトウェア・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	18.34		18.34		922	134,380	保険
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	29.81		35.7		803	117,113	運輸
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1.83		2.16		414	60,412	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	3.56		3.56		229	33,474	素材
GEBERIT AG-REG	19.86		23.22		1,034	150,722	資本財
小計	9,343.27		12,831.74		87,594	12,759,895	
(デンマーク)	40銘柄		42銘柄		—	<2.9%>	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1.68		2.06		3,026	58,434	運輸
PANDORA A/S	47.63		58.88		2,966	57,280	耐久消費財・アパレル
ORSTED A/S	95.55		120.9		7,304	141,055	公益事業
NOVO NORDISK A/S-B	908.61		1,048.8		92,283	1,782,002	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHR HANSEN HOLDING A/S	55.09		72.11		3,142	60,682	素材

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
DANSKE BANK A/S	391.03	391.03	4,971	96,008	銀行
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	524.4	654.33	11,521	222,479	資本財
GN STORE NORD A/S	64.84	64.84	1,091	21,072	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG AS-B	55.85	55.85	5,047	97,471	食品・飲料・タバコ
NOVOZYMES A/S-B SHARES	115.12	140.03	5,739	110,836	素材
COLOPLAST-B	63.99	83.16	7,180	138,646	ヘルスケア機器・サービス
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	3.11	3.11	4,691	90,591	運輸
TRYG A/S	169.89	249.75	4,109	79,357	保険
GENMAB A/S	36.88	39.34	12,510	241,570	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCKWOOL A/S-B SHS	5.13	5.13	807	15,601	資本財
DSV A/S	109.5	114.17	12,632	243,941	運輸
AMBU A/S-B	83.56	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
DEMANT A/S	44.55	81.78	1,640	31,678	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数 2,776.41	株数 3,185.27	評価額 180,668	評価額 3,488,710	
	銘柄数 18銘柄	銘柄数 17銘柄		<0.8%>	
(ノルウェー)			ノルウェー・クロネ		
SALMAR ASA	—	41.88	1,393	19,373	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	114.12	114.12	2,140	29,758	保険
NORSK HYDRO ASA	832.94	877.53	6,412	89,140	素材
AKER BP ASA	—	212.04	7,200	100,092	エネルギー
DNB BANK ASA	459.57	616.91	11,770	163,611	銀行
KONGSBERG GRUPPEN ASA	—	65.26	2,610	36,284	資本財
ORKLA ASA	469.55	469.55	3,257	45,282	食品・飲料・タバコ
TELENOR ASA	349.37	406.94	3,984	55,388	電気通信サービス
EQUINOR ASA	518.71	608.49	22,940	318,867	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	90.05	108.72	5,058	70,316	素材
MOWI ASA	233.18	233.18	3,582	49,801	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA-CL A	33.38	—	—	—	メディア・娯楽
ADEVINTA ASA	155.4	155.4	1,185	16,481	メディア・娯楽
SCHIBSTED ASA-B SHS	54.8	—	—	—	メディア・娯楽
小計	株数 3,311.07	株数 3,910.02	評価額 71,539	評価額 994,397	
	銘柄数 11銘柄	銘柄数 12銘柄		<0.2%>	
(スウェーデン)			スウェーデン・クロネ		
SWEDBANK AB - A SHARES	459.21	576.03	9,645	126,743	銀行
ERICSSON LM-B SHS	1,596.85	1,833.18	11,820	155,319	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VOLVO AB-B SHS	803.38	908.83	17,329	227,710	資本財
ICA GRUPPEN AB	56.14	—	—	—	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	106.42	106.42	2,806	36,874	各種金融
LUNDBERGS AB-B SHS	33.68	60.81	2,845	37,395	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B	299.42	360.76	9,213	121,069	家庭用品・パーソナル用品
EPIROC AB-A	342.3	447.46	8,835	116,093	資本財
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	82.23	82.23	1,687	22,171	資本財
KINNEVIK AB - B	124.65	124.65	1,977	25,985	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	98.51	72.11	1,910	25,109	各種金融
INVESTOR AB-A SHS	—	274.15	5,443	71,524	各種金融
SAGAX AB-B	—	147.21	3,281	43,116	不動産
LIFCO AB-B SHS	—	151.49	2,678	35,193	資本財
HOLMEN AB-B SHARES	—	70.24	3,022	39,714	素材
INDUTRADE AB	—	179.13	3,937	51,735	資本財
VOLVO CAR AB-B	—	386.28	1,921	25,244	自動車・自動車部品
SKF AB-B SHARES	206.07	206.07	3,567	46,871	資本財
ELECTROLUX AB-B	115.55	115.55	1,682	22,103	耐久消費財・アパレル
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	401.48	522.1	6,140	80,691	小売
NORDEA BANK ABP	1,679.42	2,100.76	23,078	303,257	銀行
SWEDISH MATCH AB	846.4	1,030.37	11,869	155,969	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	255.37	384.24	3,583	47,086	電気通信サービス

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等	
	株数	株数	評価金額	価額		
GETINGE AB-B SHS	—	131.51	3,136	41,213	ヘルスケア機器・サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	883.17	1,083.74	12,956	170,243	銀行	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	776.68	976.03	10,179	133,765	銀行	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	343.7	343.7	4,866	63,949	素材	
SKANSKA AB-B SHS	171.83	269.15	4,597	60,405	資本財	
SANDVIK AB	610.7	701.08	13,460	176,874	資本財	
INVESTOR AB-B SHS	1,012.75	1,117.44	21,390	281,065	各種金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	373.42	1,697.3	21,888	287,613	資本財	
SECURITAS AB-B SHS	161.23	410.1	3,620	47,571	商業・専門サービス	
TELIA CO AB	1,434.04	1,876.75	5,414	71,145	電気通信サービス	
ALFA LAVAL AB	186.97	186.97	5,524	72,598	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	197.87	1,074.24	12,504	164,304	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	521.19	624.54	14,889	195,641	資本財	
BOLIDEN AB	130.86	152.97	5,820	76,481	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	185.93	185.93	1,493	19,623	資本財	
SWEDISH ORPHAN BIVITRUM AB	—	135.13	2,960	38,903	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HEXAGON AB-B SHS	1,031.1	1,170.1	13,795	181,272	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ORRON ENERGY AB	85.81	—	—	—	公益事業	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	53.23	319.38	1,497	19,678	不動産	
EQT AB	154.43	231.94	5,473	71,925	各種金融	
EVOLUTION AB	90.21	112.54	11,742	154,295	消費者サービス	
VOLVO AB-A SHS	132.83	132.83	2,675	35,152	資本財	
EMBRACER GROUP AB	300.12	300.12	1,348	17,716	メディア・娯楽	
EPIROC AB-B	198.36	198.36	3,372	44,309	資本財	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	737.64	892.71	8,736	114,791	資本財	
SINCH AB	276.9	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	17,558.05 41銘柄	24,464.63 46銘柄	331,622 —	4,357,523 <1.0%>
(ユーロ・・・アイルランド)				千ユーロ		
KINGSPAN GROUP PLC	80.84	95.97	518	74,463	資本財	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	129.21	171.89	596	85,713	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	88.69	110.19	1,527	219,359	消費者サービス	
KERRY GROUP PLC-A	81.93	98.94	898	129,073	食品・飲料・タバコ	
CRH PLC	434.26	459.64	1,763	253,223	素材	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	814.93 5銘柄	936.63 5銘柄	5,305 —	761,833 <0.2%>
(ユーロ・・・オランダ)				千ユーロ		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	477.6	527.27	742	106,593	ヘルスケア機器・サービス	
AIRBUS SE	320.94	381.7	4,167	598,355	資本財	
HEINEKEN HOLDING NV	61.68	61.68	447	64,206	食品・飲料・タバコ	
NN GROUP NV	140.69	169.17	682	97,959	保険	
QIAGEN N.V.	125.43	156.65	739	106,116	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABN AMRO BANK NV-CVA	287.87	287.87	353	50,756	銀行	
STELLANTIS NV	1,055.16	1,392.38	2,048	294,079	自動車・自動車部品	
VOPAK	31.3	—	—	—	エネルギー	
FERRARI NV	69.49	79.86	1,665	239,072	自動車・自動車部品	
ADYEN NV	10.69	13.94	1,989	285,614	ソフトウェア・サービス	
PROSUS NV	510.18	510.27	3,075	441,565	小売	
CNH INDUSTRIAL NV	547.75	687.66	1,045	150,076	資本財	
ASM INTERNATIONAL NV	24.55	31.7	811	116,586	半導体・半導体製造装置	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	384.96	444.22	988	141,912	メディア・娯楽	
OCI NV	—	60	239	34,407	素材	
EXOR NV	—	62.04	458	65,827	各種金融	
HEINEKEN NV	131.43	160.91	1,427	204,927	食品・飲料・タバコ	
AEGON NV	916.09	1,277.48	596	85,657	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	556.57	646.61	1,806	259,395	食品・生活必需品小売り	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
AKZO NOBEL N.V.	98.86	124.75	851	122,300	素材
KONINKLIJKE DSM NV	94.22	104.33	1,251	179,681	素材
WOLTERS KLUWER	145.78	163.6	1,706	244,997	商業・専門サービス
ING GROEP NV	2,052.37	2,541.05	2,963	425,481	銀行
KONINKLIJKE KPN NV	1,736.03	2,221.79	646	92,862	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	225.44	257.52	14,415	2,069,844	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	62.41	89.46	498	71,596	商業・専門サービス
JDE PEET'S NV	21.66	66.6	194	27,922	食品・飲料・タバコ
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	280.21	354.07	355	51,015	食品・飲料・タバコ
EURONEXT NV	—	55.02	394	56,704	各種金融
IMCD NV	—	32.14	447	64,213	資本財
ARGENX SE	26.44	35.03	1,276	183,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUST EAT TAKEAWAY	93.07	129.03	270	38,793	小売
EXOR NV	62.04	—	—	—	各種金融
STMICROELECTRONICS NV	378.04	435.38	1,556	223,479	半導体・半導体製造装置
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	50,113	7,195,231	
	金額 比率	金額 比率	—	< 1.6% >	
(ユーロ・・・ベルギー)			千ユーロ		
SOFINA	8.04	8.04	169	24,357	各種金融
UCB SA	66.23	77.82	600	86,191	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KBC GROUP NV	130.92	149.1	783	112,433	銀行
COLRUYT SA	21.64	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	59.14	59.14	455	65,434	各種金融
SOLVAY SA	37.58	48.02	452	64,906	素材
UMICORE	102.88	131.6	450	64,659	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	409.43	566.32	3,182	456,974	食品・飲料・タバコ
ACEAS	112.47	112.47	425	61,057	保険
D'IETTEREN GROUP	—	14.49	257	37,032	小売
PROXIMUS	46.17	108.95	110	15,885	電気通信サービス
ELIA GROUP SA/NV	20.63	21.11	283	40,675	公益事業
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	7,170	1,029,608	
	金額 比率	金額 比率	—	< 0.2% >	
(ユーロ・・・ルクセンブルグ)			千ユーロ		
ARCELORMITTAL	366.89	370.54	961	138,006	素材
TENARIS SA	259.63	259.63	425	61,060	エネルギー
EUROFINS SCIENTIFIC	70.1	92.7	621	89,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AROUNDTOWN SA	525.6	735.08	171	24,654	不動産
INPOST SA	109.02	—	—	—	運輸
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	2,179	312,951	
	金額 比率	金額 比率	—	< 0.1% >	
(ユーロ・・・フランス)			千ユーロ		
BUREAU VERITAS SA	178.17	178.17	448	64,389	商業・専門サービス
ORANGE	1,061.32	1,277.98	1,258	180,629	電気通信サービス
GETLINK SE	223.11	304.28	483	69,486	運輸
SUEZ	189.86	—	—	—	公益事業
DASSAULT AVIATION SA	17.2	17.2	260	37,339	資本財
FAURECIA	60.9	—	—	—	自動車・自動車部品
TOTALENERGIES SE	1,354.3	1,581.13	9,319	1,338,047	エネルギー
TELEPERFORMANCE	29.7	34.2	731	105,083	商業・専門サービス
WORLDLINE SA	127.74	166.77	747	107,296	ソフトウェア・サービス
ESSILORLUXOTTICA	157.04	178.07	3,125	448,705	ヘルスケア機器・サービス
AMUNDI SA	39.55	39.55	208	29,869	各種金融
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	15.55	15.55	490	70,485	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICHELIN (CGDE)	87.46	456.59	1,207	173,333	自動車・自動車部品
AIR LIQUIDE SA	251.83	334.12	4,636	665,672	素材
KERING	39.06	47.59	2,629	377,590	耐久消費財・アパレル



# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	293.3	348.68	4,842	695,281	資本財
BOUYGUES SA	110.49	171.23	508	73,067	資本財
BNP PARIBAS	612.93	720.2	3,858	553,947	銀行
THALES SA	54.03	70.74	861	123,761	資本財
DANONE	343	407.11	2,047	294,017	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	359.9	359.9	594	85,314	食品・生活必需品小売り
VIVENDI SE	384.96	384.96	329	47,258	メディア・娯楽
L'OREAL	136.29	151.95	5,280	758,140	家庭用品・パーソナル用品
LEGRAND SA	133.23	168.52	1,315	188,874	資本財
PERNOD RICARD SA	111.08	137.33	2,567	368,625	食品・飲料・タバコ
SOCIETE GENERALE SA	410.25	485.58	1,169	167,849	銀行
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	148.67	177	12,425	1,784,038	耐久消費財・アパレル
ACCOR SA	104.51	104.51	260	37,333	消費者サービス
CAPGEMINI SE	89.61	104.53	1,805	259,270	ソフトウェア・サービス
VALEO	144.44	144.44	254	36,562	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	133.01	133.01	837	120,314	メディア・娯楽
SODEXO SA	39	47.6	433	62,220	消費者サービス
SEB SA	11.27	11.27	86	12,427	耐久消費財・アパレル
AXA SA	1,004.73	1,195.47	3,270	469,536	保険
EDENRED	121.39	146.5	770	110,683	ソフトウェア・サービス
RENAULT SA	88.3	147.64	498	71,607	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	16.76	19.73	2,927	420,392	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	45.92	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DASSAULT SYSTEMES SE	351.15	400.49	1,391	199,849	ソフトウェア・サービス
ALSTOM	176.65	176.65	433	62,292	資本財
CNP ASSURANCES	89.78	—	—	—	保険
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	264.13	294.71	1,302	186,945	資本財
SANOFI	615.68	730.53	6,442	925,020	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VINCI SA	293.09	340.5	3,288	472,218	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	361.22	421.62	1,025	147,224	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	581.4	731.02	702	100,824	銀行
ENGIE	948.86	1,178.99	1,693	243,085	公益事業
UBISOFT ENTERTAINMENT	47.45	47.45	124	17,849	メディア・娯楽
EDF	207.79	326.58	391	56,268	公益事業
SAFRAN SA	182.12	217.82	2,537	364,349	資本財
ARKEMA	32.5	32.5	272	39,169	素材
SCOR SE	109.07	—	—	—	保険
IPSEN	14.98	14.98	162	23,401	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOLLORRE SE	394.33	692.88	362	52,079	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	12.73	12.73	205	29,573	食品・飲料・タバコ
EURAZEO SE	17.92	17.92	108	15,566	各種金融
ORPEA	26.95	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WENDEL	10.82	10.82	94	13,523	各種金融
EIFFAGE	49.89	49.89	471	67,649	資本財
ADP	13.46	13.46	196	28,157	運輸
BIOMERIEUX	15.7	27.91	268	38,494	ヘルスケア機器・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	57.85	57.85	216	31,073	消費者サービス
小計	株数	金額	94,184	13,523,070	
	銘柄数	<比率>	—	<3.1%>	
	62銘柄	56銘柄	—	—	
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ		
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	468.95	796.54	180	25,938	電気通信サービス
BAYER AG-REG	517.33	637.81	3,569	512,463	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA	59.74	59.74	385	55,324	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	86.77	86.77	455	65,381	素材
EVONIK INDUSTRIES AG	109.52	176.69	327	47,021	素材
VONOVIA SE	395	463.39	1,102	158,349	不動産



外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	77.65	100.89	585	84,017	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	25.64	36.79	294	42,337	自動車・自動車部品
KION GROUP AG	31.79	31.79	86	12,374	資本財
ZALANDO SE	123.67	123.67	361	51,937	小売
BECHTLE AG	43.05	43.05	146	21,021	ソフトウェア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	52.69	52.69	100	14,479	電気通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,134.78	1,272.33	1,299	186,517	各種金融
COVESTRO AG	117.97	117.97	450	64,754	素材
MTU AERO ENGINES AG	29.57	38.54	760	109,232	資本財
UNIPER SE	46.97	46.97	22	3,229	公益事業
COMMERZBANK AG	466.44	606.4	485	69,758	銀行
VOLKSWAGEN AG	19.6	19.6	356	51,133	自動車・自動車部品
SARTORIUS AG-VORZUG	13.08	16.82	594	85,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	97.76	118.44	1,632	234,405	自動車・自動車部品
LEG IMMOBILIEN SE	36.8	45.38	279	40,110	不動産
NEMETSCHKE SE	30.11	30.11	137	19,735	ソフトウェア・サービス
RATIONAL AG	3.5	3.5	203	29,272	資本財
SYMRISE AG	65.24	84.04	904	129,895	素材
DELIVERY HERO SE	80.61	85.3	335	48,230	小売
SIEMENS ENERGY AG	198.55	318.78	499	71,722	資本財
TEAMVIEWER AG	90.59	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VONOVIA SE-RTS	293.04	—	—	—	不動産
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	293.58	908	130,503	資本財
RHEINMETALL AG	—	28.99	560	80,521	資本財
DR ING HC F PORSCHE AG	—	70	745	106,988	自動車・自動車部品
SIEMENS AG-REG	409.05	488.9	6,506	934,171	資本財
E.ON SE	1,269.98	1,473.18	1,338	192,186	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	178.73	203.47	1,724	247,590	自動車・自動車部品
GEA GROUP AG	81.78	81.78	318	45,676	資本財
CONTINENTAL AG	55.78	80.78	467	67,131	自動車・自動車部品
BASF SE	494.39	590.53	2,897	415,971	素材
ALLIANZ SE-REG	217.83	263.07	5,408	776,583	保険
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	90.43	103.98	711	102,087	家庭用品・パーソナル用品
RWE AG	346.73	386.04	1,611	231,354	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	331.48	331.48	251	36,133	運輸
BRENNTAG SE	73.92	99.2	600	86,284	資本財
FRESENIUS SE & CO KGAA	213.63	232.54	610	87,710	ヘルスケア機器・サービス
SAP SE	550.37	669.88	6,905	991,437	ソフトウェア・サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	73.64	90.23	2,720	390,599	保険
BEIERSDORF AG	51.38	68.13	701	100,706	家庭用品・パーソナル用品
MERCK KGAA	68.32	77.77	1,338	192,170	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADIDAS AG	101.46	103.95	1,257	180,504	耐久消費財・アパレル
PUMA SE	50.52	64.59	309	44,375	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,830.3	2,082.85	4,054	582,081	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	111.18	136.13	403	57,972	ヘルスケア機器・サービス
MERCEDES-BENZ GROUP AG	466.8	522.42	3,267	469,106	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	715.33	796.41	2,437	349,906	半導体・半導体製造装置
HANNOVER RUECK SE	30.58	35.98	651	93,608	保険
DEUTSCHE POST AG-REG	544.53	621.78	2,352	337,817	運輸
DEUTSCHE BOERSE AG	107.01	119.16	2,055	295,130	各種金融
LANKESS AG	44.09	—	—	—	素材
FUCHS PETROLUB SE-PREF	33.7	—	—	—	素材
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	19.24	21.61	274	39,374	ヘルスケア機器・サービス
KNORR-BREMSE AG	38.81	38.81	209	30,090	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	164.26	164.26	828	118,959	ヘルスケア機器・サービス
SCOUT24 SE	46.71	46.71	238	34,270	メディア・娯楽

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	金額	期首(前期末)	期	期末		業種等
			株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
HELLOFRESH SE	97.9	97.9	221	31,851			食品・生活必需品小売り
小計	株数 銘柄数	金額 比率	13,626.27 60銘柄	15,900.09 59銘柄	70,447	10,114,853	< 2.3% >
(ユーロ・・・ポルトガル)					千ユーロ		
GALP ENERGIA SGPS SA	296.87	259.2	300	43,133			エネルギー
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	1,879.06	—	—	—			銀行
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,459.1	1,952.32	862	123,898			公益事業
JERONIMO MARTINS	163.97	173.93	371	53,292			食品・生活必需品小売り
小計	株数 銘柄数	金額 比率	3,799 4銘柄	2,385.45 3銘柄	1,534	220,324	< 0.0% >
(ユーロ・・・スペイン)					千ユーロ		
TELEFONICA SA	2,742.78	3,359.1	1,205	173,145			電気通信サービス
FERROVIAL SA	246.93	321.77	821	117,947			資本財
AENA SME SA	43.77	43.77	531	76,262			運輸
EDP RENOVAVEIS SA	147.91	177.64	386	55,423			公益事業
CAIXABANK SA	2,181.03	2,907.77	1,031	148,128			銀行
CELLNEX TELECOM SA	270.81	328.3	1,070	153,714			電気通信サービス
ENDESA SA	141.04	141.04	247	35,529			公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,528.89	4,202.32	2,363	339,334			銀行
IBERDROLA SA	3,127.16	3,768.63	4,015	576,541			公益事業
REPSOL SA	793.58	964.57	1,411	202,684			エネルギー
GRIFOLS SA	151.69	151.69	150	21,657			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANCO SANTANDER SA	9,272.2	10,464.74	2,966	425,966			銀行
AMADEUS IT GROUP SA	245.7	299.28	1,522	218,548			ソフトウェア・サービス
NATURGY ENERGY GROUP SA	154.39	106.03	278	39,916			公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	129.31	131.89	353	50,807			資本財
ACCIONA SA	—	18.1	328	47,116			公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	583.28	713.41	1,777	255,259			小売
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	114.82	197.73	356	51,130			資本財
ENAGAS SA	144.71	144.71	250	35,945			公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	236.32	236.32	401	57,631			公益事業
小計	株数 銘柄数	金額 比率	24,256.32 19銘柄	28,678.81 20銘柄	21,470	3,082,692	< 0.7% >
(ユーロ・・・イタリア)					千ユーロ		
MONCLER SPA	122.09	122.09	586	84,142			耐久消費財・アパレル
PRYSMIAN SPA	125.26	171.86	579	83,206			資本財
DIASORIN SPA	13.13	13.13	169	24,300			ヘルスケア機器・サービス
TELECOM ITALIA-RSP	3,783.08	—	—	—			電気通信サービス
POSTE ITALIANE SPA	265.62	347.2	327	46,969			保険
FINECOBANK SPA	320.34	430.93	651	93,551			銀行
ASSICURAZIONI GENERALI	573.03	723.82	1,226	176,050			保険
MEDIOBANCA SPA	313.03	477.08	441	63,402			銀行
UNICREDIT SPA	1,128.45	1,279.61	1,658	238,109			銀行
INTESA SANPAOLO	9,050.32	10,118.86	2,159	310,041			銀行
ATLANTIA SPA	265.01	265.01	607	87,248			運輸
ENI SPA	1,369.72	1,601.58	2,273	326,443			エネルギー
ENEL SPA	4,316.52	5,010.6	2,558	367,336			公益事業
SNAM SPA	1,067.07	1,338.67	642	92,201			公益事業
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	871.42	1,016.86	731	105,091			公益事業
TELECOM ITALIA SPA	3,905.36	6,963.55	151	21,696			電気通信サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	45.78	80.68	322	46,347			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPLIFON SPA	75.67	75.67	205	29,454			ヘルスケア機器・サービス
NEXI SPA	206.12	308.53	257	36,945			ソフトウェア・サービス
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	158.04	158.04	148	21,298			電気通信サービス
小計	株数 銘柄数	金額 比率	27,975.06 20銘柄	30,503.77 19銘柄	15,697	2,253,838	< 0.5% >

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等	
	株数	株数	評価額	評価額		
		株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
千ユーロ						
(ユーロ・・・フィンランド)						
WARTSILA OYJ ABP	267.53	267.53	218	31,382	資本財	
NESTE OYJ	214.27	265.63	1,240	178,071	エネルギー	
UPM-KYMMENE OYJ	280.55	328.18	1,137	163,318	素材	
NOKIA OYJ	2,801.61	3,486.1	1,593	228,794	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	302.34	392.28	550	79,078	素材	
ELISA OYJ	86.81	101.6	503	72,296	電気通信サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	284.54	298.43	1,442	207,087	保険	
FORTUM OYJ	243.12	243.12	365	52,430	公益事業	
KESKO OYJ-B SHS	134.02	202.5	415	59,690	食品・生活必需品小売り	
KONE OYJ-B	176.18	206.23	1,000	143,610	資本財	
ORION OYJ-CLASS B	62.61	62.61	315	45,325	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数	金額	株数	金額		
	11銘柄	4,853.58	11銘柄	8,783	1,261,086	
		<比率>			<0.3%>	
千ユーロ						
(ユーロ・・・オーストリア)						
OMV AG	83.89	83.89	415	59,718	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	193.83	205.06	603	86,619	銀行	
VOESTALPINE AG	60.56	73.82	193	27,769	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	70.66	—	—	—	銀行	
VERBUND AG	31.9	53.46	458	65,781	公益事業	
小計	株数	金額	株数	金額		
	5銘柄	440.84	4銘柄	1,670	239,889	
		<比率>			<0.1%>	
ユーロ通貨計	株数	金額	株数	金額		
	232銘柄	102,646.7	224銘柄	278,558	39,995,380	
		<比率>			<9.0%>	
合計	株数	金額	株数	金額		
	1,223銘柄	583,591.19	1,209銘柄	411,677,365		
		<比率>			<93.1%>	

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

※〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

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

外国株式インデックス・マザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首 (前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額		組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカ・ドル	千円	%	
AGNC INVESTMENT CORP	25,432	—	—	—	—	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,344	9,096	1,553	215,735	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	17,345	20,565	2,415	335,449	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	7,835	9,604	678	94,279	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	8,706	8,706	220	30,599	0.0	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	—	22,843	455	63,222	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916	7,141	2,103	292,096	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	18,773	22,609	1,437	199,622	0.0	
EQUINIX INC	4,908	5,902	3,960	549,926	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	24,648	28,877	6,272	871,084	0.2	
SUN COMMUNITIES INC	6,088	7,129	1,032	143,362	0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	—	17,613	908	126,135	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	37,569	46,189	861	119,690	0.0	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	—	20,093	653	90,713	0.0	
REALTY INCOME CORP	28,298	36,686	2,285	317,392	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,780	7,866	1,273	176,873	0.0	
INVITATION HOMES INC	32,632	36,871	1,176	163,439	0.0	
VICI PROPERTIES INC	36,025	60,354	2,032	282,200	0.1	
KIMCO REALTY CORP	—	35,169	799	110,962	0.0	
VENTAS INC	19,379	23,363	1,060	147,296	0.0	
WEYERHAEUSER CO	38,940	47,220	1,499	208,264	0.0	
CROWN CASTLE INC	22,634	27,033	3,760	522,229	0.1	
IRON MOUNTAIN INC	14,204	19,659	1,058	147,040	0.0	
PROLOGIS INC	40,178	59,103	6,726	934,110	0.2	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,662	9,773	1,490	206,996	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	6,009	707	98,258	0.0	
DUKE REALTY CORP	21,667	—	—	—	—	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	4,379	939	130,433	0.0	
WELLTOWER INC	23,388	27,308	1,889	262,424	0.1	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756	36,377	932	129,524	0.0	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,664	11,186	731	101,638	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	64,936	22,502	477	66,278	0.0	
PUBLIC STORAGE	8,249	10,308	2,995	415,985	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	8,289	9,608	632	87,821	0.0	
UDR INC	16,633	20,610	839	116,631	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	10,364	—	—	—	—	

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首 (前期末)		期		末		
	口数	金額	口数	金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	組入比率
DIGITAL REALTY TRUST INC	15,126		18,137		1,972	273,907	
EXTRA SPACE STORAGE INC	7,376		8,530		1,309	181,853	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858		31,858		413	57,425	0.0
WP CAREY INC	8,640		11,067		865	120,214	0.0
小計	口数・金額	672,476	807,343		60,424	8,391,121	1.9
	銘柄数 <比率>	36銘柄	37銘柄			<1.9%>	
(カナダ)					千カナダ・ドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,971		8,170		353	36,140	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441		7,441		158	16,168	0.0
小計	口数・金額	11,412	15,611		512	52,309	0.0
	銘柄数 <比率>	2銘柄	2銘柄			<0.0%>	
(オーストラリア)					千オーストラリア・ドル		
SCENTRE GROUP	275,200		350,311		1,029	95,565	0.0
LENLEASE GROUP	36,263		36,263		276	25,640	0.0
DEXUS/AU	54,256		79,604		625	58,057	0.0
TRANSURBAN GROUP	161,485		190,071		2,697	250,264	0.1
SYDNEY AIRPORT	62,186		—		—	—	—
APA GROUP	55,644		75,718		850	78,900	0.0
GPT GROUP	121,221		121,221		529	49,154	0.0
MIRVAC GROUP	200,053		251,619		558	51,831	0.0
STOCKLAND	127,393		127,393		484	44,919	0.0
GOODMAN GROUP	86,301		106,251		1,985	184,265	0.0
VICINITY CENTRES	241,241		241,241		489	45,441	0.0
小計	口数・金額	1,421,243	1,579,692		9,527	884,040	0.2
	銘柄数 <比率>	11銘柄	10銘柄			<0.2%>	
(香港)					千香港・ドル		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000		276,000		2,586	45,981	0.0
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	193,500		193,500		1,075	19,128	0.0
LINK REIT	110,100		136,600		7,185	127,752	0.0
小計	口数・金額	500,600	606,100		10,847	192,862	0.0
	銘柄数 <比率>	3銘柄	3銘柄			<0.0%>	
(シンガポール)					千シンガポール・ドル		
CAPITALAND ASCENDAS REIT	170,500		219,000		604	61,072	0.0
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	259,616		303,516		631	63,787	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100		208,100		335	33,852	0.0
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400		112,400		194	19,647	0.0
小計	口数・金額	750,616	843,016		1,765	178,360	0.0
	銘柄数 <比率>	4銘柄	4銘柄			<0.0%>	

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘 柄	口 数	期 末			
		口 数	評 価 額		組 入 比 率
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(イギリス)</b>					
LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861	39,861	千イギリス・ポンド 247	41,121	0.0
SEGR0 PLC	68,623	78,831	637	105,933	0.0
BRITISH LAND CO PLC	44,962	49,008	198	32,969	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	153,446 3銘柄	167,700 3銘柄	1,082	180,024 <0.0%>
<b>(ユーロ・・・ベルギー)</b>					
WAREHOUSES DE PAUW SCA	—	9,913	千ユーロ 254	36,607	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	— —	9,913 1銘柄	254 <0.0%>	36,607 <0.0%>
<b>(ユーロ・・・フランス)</b>					
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024	7,024	千ユーロ 365	52,422	0.0
GECINA SA	2,189	3,082	292	41,928	0.0
KLEPIERRE	13,600	13,600	303	43,505	0.0
COVIVIO	2,388	2,388	134	19,320	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	25,201 4銘柄	26,094 4銘柄	1,094 <0.0%>	157,176 <0.0%>
ユーロ通貨計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	25,201 4銘柄	36,007 5銘柄	1,349 <0.0%>	193,784 <0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,534,994 63銘柄	4,055,469 64銘柄	—	10,072,502 <2.3%>

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

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	期 末	
	買 建 額	売 建 額
外	百万円	百万円
S & P 500 EMINI FUT	15,983	—
S P I 200 FUTURE S	757	—
国	—	—
F T S E 100 I D X F U T	963	—
E U R O S T O X X 50	3,089	—

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

# 外国株式インデックス・マザーファンド

## ■ 投資信託財産の構成

(2022年11月30日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	411,677,365	93.1
投 資 証 券	10,072,502	2.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	20,646,824	4.7
投 資 信 託 財 産 総 額	442,396,692	100.0

※期末における外貨建資産(440,169,581千円)の投資信託財産総額(442,396,692千円)に対する比率は99.5%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=138.87円、1カナダ・ドル=102.16円、1オーストラリア・ドル=92.79円、1香港・ドル=17.78円、1シンガポール・ドル=101.04円、1ニュージーランド・ドル=86.13円、1イギリス・ポンド=166.23円、1イスラエル・シェケル=40.334円、1スイス・フラン=145.67円、1デンマーク・クローネ=19.31円、1ノルウェー・クローネ=13.90円、1スウェーデン・クローナ=13.14円、1ユーロ=143.58円です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	445,475,559,094円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	14,541,913,780
株 式(評価額)	411,677,365,126
投 資 証 券(評価額)	10,072,502,218
未 収 入 金	3,568,262,597
未 収 配 当 金	582,453,884
差 入 委 託 証 拠 金	5,033,061,489
(B) 負 債	3,273,997,642
未 払 金	3,112,990,857
未 払 解 約 金	161,000,409
そ の 他 未 払 費 用	6,376
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	442,201,561,452
元 本	72,186,242,919
次 期 繰 越 損 益 金	370,015,318,533
(D) 受 益 権 総 口 数	72,186,242,919口
1万口当たり基準価額(C/D)	61,258円

※当期における期首元本額60,650,874,522円、期中追加設定元本額22,050,143,482円、期中一部解約元本額10,514,775,085円です。

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

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

## ■ 損益の状況

(自2021年12月1日 至2022年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	7,287,501,862円
受 取 配 当 金	7,253,557,434
受 取 利 息	8,351,669
そ の 他 収 益 金	26,025,121
支 払 利 息	△ 432,362
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	11,547,232,777
売 買 損 益	99,265,619,371
売 買 損 益	△ 87,718,386,594
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 84,643,124
取 引 損 益	2,643,294,548
取 引 損 益	△ 2,727,937,672
(D) そ の 他 費 用 等	△ 145,059,032
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	18,605,032,483
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	293,167,362,270
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 50,863,192,984
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	109,106,116,764
(I) 合 計(E+F+G+H)	370,015,318,533
次 期 繰 越 損 益 金(I)	370,015,318,533

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

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

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

## 外国株式インデックス・マザーファンド

### ■ 期末における、当ファンドの元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	36,369,253,618円	三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	50,536,075円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	284,736,068円	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	449,296,410円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,090,013,037円	バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	3,279,377円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	785,999,194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＞	20,004,315円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	33,400,233円	SMAM・バランスファンドVA2.5＜適格機関投資家専用＞	536,704,870円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2020（4資産タイプ）	1,017,107円	SMAM・バランスファンドVA3.7.5＜適格機関投資家専用＞	702,957,041円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2025（4資産タイプ）	5,342,658円	SMAM・バランスファンドVA5.0＜適格機関投資家専用＞	3,074,190,088円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2030（4資産タイプ）	16,884,192円	SMAM・バランスファンドVL3.0＜適格機関投資家限定＞	9,972,101円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2035（4資産タイプ）	49,323,143円	SMAM・バランスファンドVL5.0＜適格機関投資家限定＞	49,989,232円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2040（4資産タイプ）	54,445,231円	SMAM・バランスファンドVA7.5＜適格機関投資家専用＞	423,311,736円
三井住友・DCターゲットイヤーフンド2045（4資産タイプ）	105,113,958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＞	36,093,954円
外国株式指数ファンド	936,693,371円	SMAM・インデックス・バランスVA2.5＜適格機関投資家専用＞	90,939,599円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	17,542,779,547円	SMAM・インデックス・バランスVA5.0＜適格機関投資家専用＞	427,001,205円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	90,349,697円	SMAM・バランスファンドVA4.0＜適格機関投資家専用＞	293,567,068円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	117,821,294円	SMAM・バランスファンドVA3.5＜適格機関投資家専用＞	687,726,675円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	75,689,448円	SMAM・バランスVA株4.0T＜適格機関投資家限定＞	200,225円
イオン・バランス戦略ファンド	20,982,589円	三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	194,459,687円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2050	21,006,539円	SMAM・グローバルバランス4.0VA＜適格機関投資家限定＞	59,953,329円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	130,889,105円	SMAM・アセットバランスファンドVA2.0A＜適格機関投資家専用＞	7,255,976円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	118,201,443円	SMAM・アセットバランスファンドVA3.5A＜適格機関投資家専用＞	6,951,628円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	437,684,453円	SMAM・アセットバランスファンドVA5.0A＜適格機関投資家専用＞	3,833,026円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	238,781,337円	SMAM・アセットバランスファンドVA2.0L＜適格機関投資家専用＞	17,103,227円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	274,840,665円	SMAM・アセットバランスファンドVA2.5L＜適格機関投資家専用＞	51,782,752円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	54,612,889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＞	110,286,434円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,637,991,448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＞	46,890,632円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	10,892,390円	SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	281,352,925円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	47,697,547円	SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	80,381,144円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	42,074,552円	SMAM・外国株式インデックスファンドSA＜適格機関投資家限定＞	1,662,845,853円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2060	2,714,893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＞	17,217,947円
SMBC・DCインデックスファンド（MSCIコクサイ）	397,450,005円	SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04＜適格機関投資家限定＞	1,803,118円
日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	250,037,372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＞	2,321,567円
日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	1,466,576,467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＞	74,738,213円

### ■ お知らせ

#### ＜約款変更について＞

該当事項はございません。



# エマージング株式インデックス・マザーファンド

第12期（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

信託期間	無期限（設定日：2011年4月18日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として新興国の株式（預託証券（DR）、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。）、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。</li> <li>・外貨建資産について対円での為替ヘッジは原則として行いません。</li> </ul>

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

## ■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) MSCIエマージング・ マーケット・インデックス		株式組入 率	株式先物 率 (買建-売建)	投資信託 証券 組入比率	純資 産額
	期 騰 落	中 率	(配当込み、 円ベース)	期 騰 落				
8期（2018年11月30日）	円	%			%	%	%	百万円
9期（2019年12月2日）	13,023	△ 9.3	142.90	△ 9.0	43.2	53.6	3.1	4,401
10期（2020年11月30日）	13,315	2.2	148.27	3.8	48.2	45.1	6.8	8,381
11期（2021年11月30日）	15,253	14.6	170.44	15.0	61.5	30.4	8.3	11,054
12期（2022年11月30日）	16,743	9.8	189.30	11.1	56.5	34.1	10.1	17,548
12期（2022年11月30日）	16,483	△ 1.6	186.80	△ 1.3	69.9	19.9	10.7	26,550

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) M S C I エ マ ー ジ ン グ ・ マ ー ケ ッ ト ・ イ ン デ ッ ク ス (配 当 込 み 、 円 ベ ー ス)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比 (買 建 - 売 建)	投 資 信 託 証 券 組 入 率
	円	騰 落 率 %	189.30	騰 落 率 %			
(期 首) 2021年11月30日	16,743	—	189.30	—	56.5	34.1	10.1
12月末	16,952	1.2	191.80	1.3	64.8	24.0	11.8
2022年1月末	16,623	△0.7	188.35	△0.5	62.6	26.1	11.4
2月末	16,459	△1.7	185.64	△1.9	62.2	27.0	10.7
3月末	17,171	2.6	193.42	2.2	67.4	22.6	10.0
4月末	16,481	△1.6	185.30	△2.1	67.7	21.6	10.9
5月末	16,684	△0.4	188.70	△0.3	66.4	23.6	10.0
6月末	17,060	1.9	192.60	1.7	71.8	17.0	11.4
7月末	16,659	△0.5	187.77	△0.8	68.7	20.6	11.0
8月末	17,005	1.6	193.28	2.1	68.4	21.2	10.9
9月末	15,730	△6.1	178.07	△5.9	76.3	10.9	12.9
10月末	15,610	△6.8	176.63	△6.7	72.0	15.5	12.5
(期 末) 2022年11月30日	16,483	△1.6	186.80	△1.3	69.9	19.9	10.7

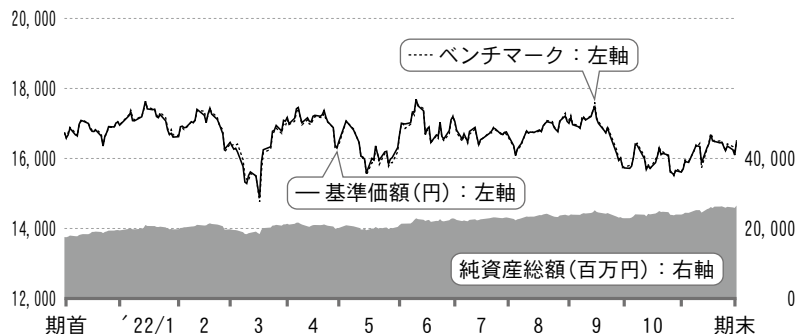
※騰落率は期首比です。

※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（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

### 基準価額等の推移



期首	16,743円
期末	16,483円
騰落率	-1.6%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）です。  
 ※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

## ▶ 基準価額の主な変動要因（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

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

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 渡航制限の緩和など経済活動の再開の動きを好感して、東南アジア株式市場の一部が上昇したこと</li> <li>・ 米国の金利上昇に伴う米ドル高・円安の進展により、投資対象市場の通貨が総じて円に対して上昇したこと</li> </ul>
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 米国の金利上昇とロシアによるウクライナ侵攻に伴う地政学リスクの高まりにより、投資対象市場の株式市場が概ね下落したこと</li> <li>・ 中国景気の先行き不透明感、IT（情報技術）サプライチェーン（供給網）の混乱に対する懸念などから、香港や中国本土、台湾、韓国などの株式市場が下落したこと</li> </ul>

---

▶ 投資環境について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

---

新興国株式市場は、下落しました。投資対象市場の通貨は総じて円に対して上昇しました。

**新興国株式市場**

期を通じて、米国の利上げにより世界の金融市場は引き締め局面へ移行しました。米国に追隨してインフレが顕在化した欧州や、オーストラリア、インドなどが利上げを実施し、世界的に株式市場は下落圧力が強まりました。

香港や中国市場は、幅広い分野で政府介入が強まることへの警戒感、ロシアのウクライナ侵攻、中国各地での新型コロナウイルスの感染拡大、根強い不動産問題や米中関係などの不透明感が払しょくされなかったことなどから、下落しました。

台湾や韓国市場は、感染者数の増勢が続いたことや世界的なITや自動車などの供給網の混乱を嫌気したこと、急激な金利上昇に伴う世界的な景気後退懸念から下落しました。

一方で東南アジア市場は、海外からの渡航客の受け入れなどリオープニングに伴う経済活動の活性化など域内の景気回復への期待から、総じて上昇しました。

**為替市場**

米ドル・円相場は米国の政策金利及び先行きの金利見通しが大幅に引き上げられたことや、日銀が金利上昇を抑制するスタンスを示したことなどから日米金利差がさらに拡大するとの観測が強まり、米ドル高・円安が進みました。11月上旬から期末にかけては、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げペースが鈍化するとの観測から米金利が低下に転じたことで、米ドル安・円高となりました。

投資対象市場の通貨も、円に対しては概ね米ドル・円に沿った動きとなり、期を通じて対円で上昇しました。

---

▶ ポートフォリオについて（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

---

**株式組入比率**

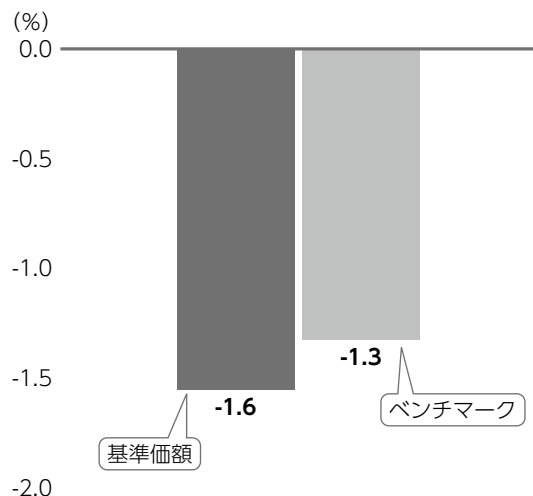
期を通じて、株式、投資信託証券および先物の組入れにより、実質株式組入比率は100%に近い高位を保ちました。

**運用経過**

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

▶ ベンチマークとの差異について（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



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

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は-1.6%となり、ベンチマークの騰落率-1.3%を0.3%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・ 売買コスト、保管費用等の支払いが生じたこと
- ・ ベンチマークと先物にリターンの差異が生じたこと
- ・ 配当に対する現地源泉税が生じたこと

## 2 今後の運用方針

引き続き、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。また、株式組入比率（投資信託証券、先物含む）を概ね100%程度に保つことを基本とします。

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

### ■ 1万口当たりの費用明細 (2021年12月1日から2022年11月30日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) (投 資 信 託 証 券)	25円 (18) (0) (5) (2)	0.151% (0.109) (0.000) (0.028) (0.015)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券)	6 (6) (0) (0)	0.036 (0.036) (0.000) (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	19 (18) (1)	0.116 (0.107) (0.009)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	51	0.304	

期中の平均基準価額は16,642円です。

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

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

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年12月1日から2022年11月30日まで)

#### (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 1,830.24 (Δ 212.7)	千アメリカ・ドル 3,404 (Δ 28)	百株 580.16	千アメリカ・ドル 2,859
	香 港	97,958.3 ( 531.18)	千香港・ドル 185,208 (Δ 69)	10,277.23	千香港・ドル 2,169
	台 湾	39,841 ( 121.99)	千台湾・ドル 375,644 (Δ 2,827)	1,104.1	千台湾・ドル 6,753
	エ ジ プ ト	283.06 ( 264.6)	千エジプト・ポンド 895 ( - )	104.41	千エジプト・ポンド 21
	ト ル コ	1,817.39 ( 273.63)	千トルコ・リラ 4,472 ( - )	354.53	千トルコ・リラ 513
	メ キ シ コ	5,594.65 ( 348.55)	千メキシコ・ペソ 24,143 ( - )	230	千メキシコ・ペソ 751

エマージング株式インデックス・マザーファンド

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外	フィリピン	7,198.95 (140.26)	千フィリピン・ペソ 35,212 (—)	0.46 —
	チリ	19,924.36 (0.83)	千チリ・ペソ 378,111 (—)	1,296.35 11,548
	コロンビア	840.09	千コロンビア・ペソ 545,409	29.86 132,393
	インド	11,023.88 (3,004.01)	千インド・ルピー 844,707 (—)	519.68 13,967
	インドネシア	45,861 (94.61)	千インドネシア・ルピア 22,662,900 (26,774)	360 348,353
	ブラジル	8,554.84 (704.19)	千ブラジル・レアル 21,329 (△44)	389.36 497
	チェコ	29.96	千チェコ・コルナ 2,648	— —
	韓国	1,781.7 (22.21)	千韓国・ウォン 13,219,712 (—)	31.32 104,191
	マレーシア	9,602 (211.5)	千マレーシア・リンギット 5,369 (—)	431.68 121
	南アフリカ	3,756.11 (31.69)	千南アフリカ・ランド 46,247 (△372)	205.71 907
	タイ	15,850 (—)	千タイ・バーツ 57,644 (△3)	287 2,052
	ポーランド	720.81 (△330.18)	千ポーランド・ズロチ 2,499 (—)	— —
	ハンガリー	40.22	千ハンガリー・フォリント 29,023	— —
	国	ユーロ		千ユーロ
ギリシャ		758.86 (—)	233 (△3)	— —
キプロス		— (19.84)	— (—)	19.84 0

※金額は受渡し代金。

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

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

### (2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外国	タイ	証券 18,120	千タイ・パーツ 3	証券 27,180	千タイ・パーツ 15

※金額は受渡し代金。

### (3) 投資信託証券

			買 付		売 付	
			口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外	ア メ リ カ	ISHRS MSCI SAUDI ARABIA ETF	□ 82,110	千アメリカ・ドル 3,624	□ -	千アメリカ・ドル -
		GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	-	-	729	17
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	21,929	982	108,054	1,092
		ISHARES MSCI UAE ETF	72,661	1,225	-	-
		ISHARES MSCI QATAR ETF	44,043	981	-	-
		ISHARES MSCI KUWAIT ETF	18,796	687	-	-
	メ キ シ コ	TRUST FIBRA UNO	□ 30,100	千メキシコ・ペソ 609	□ -	千メキシコ・ペソ -
		CEMEX SAB-CPO	182,300	1,769	-	-
		MEGACABLE HOLDINGS-CPO	-	-	4,184	232
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	6,175	714	-	-
		GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	20,000	803	-	-
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	21,300	3,108	-	-
	ブ ラ ジ ル	ENERGISA SA-UNITS	□ 3,000	千ブラジル・レアル 131	□ -	千ブラジル・レアル -
		BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	13,100	319	-	-
		BANCO INTER SA	1,500	54	5,700	91
		GETNET ADQUIRENCIA E SERVICIO	-	-	1,575	5
		KLABIN SA - UNIT	8,700	199	-	-
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		1,500	50	-	-	
中 国	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	□ 712,400	千オフショア・人民元 31,739	□ -	千オフショア・人民元 -	
	南アフリカ	□ 29,255	千南アフリカ・ランド 407	□ -	千南アフリカ・ランド -	

※金額は受渡し代金。



(4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 26,770	百万円 27,814	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

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

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	10,363,718千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	15,074,824千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	0.68

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2022年11月30日現在)

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	208.08	—	—	—	消費者サービス
BAIDU INC - SPON ADR	36.8	—	—	—	メディア・娯楽
YUM CHINA HOLDINGS INC	56.7	103.89	555	77,084	消費者サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	29.09	40.68	32	4,525	素材
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	—	12.01	58	8,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SOUTHERN COPPER CORP	10.88	20.96	124	17,269	素材
NETEASE INC-ADR	54.21	—	—	—	メディア・娯楽
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	68.27	134.47	392	54,527	消費者サービス
CREDICORP LTD	9.11	17.64	259	35,992	銀行
YPF S. A. -SPONSORED ADR	26.32	—	—	—	エネルギー
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	60.3	106.92	107	14,981	小売
JD.COM INC-ADR	116.57	—	—	—	小売
VNET GROUP INC-ADR	11.66	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	55.71	111.21	64	8,911	消費者サービス
JOYY INC-ADR	7.58	11.64	34	4,834	メディア・娯楽
HELLO GROUP INC -SPN ADR	21.59	—	—	—	メディア・娯楽
AUTOHOME INC-ADR	9.27	20.9	58	8,167	メディア・娯楽
WEIBO CORP-SPON ADR	8.41	14.72	21	3,013	メディア・娯楽
H WORLD GROUP LTD-ADR	24.07	47.6	171	23,836	消費者サービス
HUYA INC-ADR	11.53	—	—	—	メディア・娯楽
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	21.78	—	—	—	メディア・娯楽
PINDUODUO INC-ADR	59.14	124.66	977	135,774	小売
BAOZUN INC-SPN ADR	8.38	—	—	—	小売
GDS HOLDINGS LTD - ADR	12.03	—	—	—	ソフトウェア・サービス
51JOB INC-ADR	3.58	—	—	—	商業・専門サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	3.77	—	—	—	各種金融
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	58.2	104.16	250	34,787	運輸
NIO INC - ADR	182.31	338.95	355	49,423	自動車・自動車部品
XPENG INC - ADR	51.76	104.39	76	10,640	自動車・自動車部品
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7.87	14.69	74	10,355	半導体・半導体製造装置
LI AUTO INC - ADR	72.34	134.78	249	34,682	自動車・自動車部品
KANZHUN LTD - ADR	—	44.91	73	10,271	メディア・娯楽
DIDI GLOBAL INC	41	—	—	—	運輸
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	—	124.3	38	5,302	ソフトウェア・サービス
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	148.8	277.8	22	3,117	不動産
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	—	262	39	5,457	エネルギー
BEIGENE LTD-ADR	6.17	11.63	209	29,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GAOTU TECHEDU INC	16.59	—	—	—	消費者サービス

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
HUTCHMED CHINA-ADR	10.66	14.44	18	2,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IQIYI INC-ADR	36.43	71.66	19	2,686	メディア・娯楽
KE HOLDINGS INC-ADR	49.09	164.24	248	34,462	不動産
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	6.08	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LUFAX HOLDING LTD-ADR	23.25	188.37	30	4,211	各種金融
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	82.87	103.43	22	3,131	食品・飲料・タバコ
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	90.09	191.74	126	17,573	メディア・娯楽
ZAI LAB LTD-ADR	10.53	21.72	73	10,161	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGORA INC-ADR	6.8	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	5.88	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	15.2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DADA NEXUS LTD-ADR	7.99	—	—	—	小売
I-MAB-SPONSORED ADR	4.71	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	15.78	—	—	—	ソフトウェア・サービス
360 DIGITECH INC	11.6	26.69	38	5,396	各種金融
UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	10.71	—	—	—	各種金融
ADECOAGRO SA	16.98	—	—	—	食品・飲料・タバコ
GLOBANT SA	5.3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 金 額 銘柄 数 <比 率>	1,929.82 52銘柄	2,967.2 31銘柄	4,826 —	670,320 < 2.5%>
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,450	2,710	1,222	21,730	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	450	1,040	448	7,969	資本財
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85	130	319	5,674	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	360	865	326	5,813	各種金融
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	530	770	257	4,586	商業・専門サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	350	680	864	15,378	ソフトウェア・サービス
KINGSOFT CORP LTD	130	202	476	8,476	メディア・娯楽
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	900	1,880	184	3,275	各種金融
WHARF HOLDINGS LTD	170	300	670	11,921	不動産
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	—	290	97	1,732	エネルギー
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	161.4	381.4	427	7,595	運輸
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	600	1,000	194	3,449	公益事業
KINGBOARD HOLDINGS LTD	100	135	324	5,760	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	670	1,290	666	11,858	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INTL HOLDINGS	130	270	190	3,384	運輸
CHINA EVERBRIGHT LTD	80	—	—	—	各種金融
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	75	105	267	4,760	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	790	1,480	1,518	26,998	自動車・自動車部品
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	220	220	140	2,491	運輸
DONGYUE GROUP	—	430	359	6,391	素材
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	130	280	187	3,335	食品・飲料・タバコ

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
CGN POWER CO LTD-H	1,670	2,290	423	7,532	公益事業
CHINA VANKE CO LTD-H	221	392	649	11,541	不動産
SSY GROUP LTD	100	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	60	140	372	6,621	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	200	420	2,165	38,495	食品・飲料・タバコ
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	330	530	201	3,580	不動産
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	520	1,000	610	10,845	小売
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,100	2,600	113	2,010	メディア・娯楽
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	-	30	415	7,382	運輸
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	260	480	595	10,582	食品・飲料・タバコ
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	125	225	293	5,224	不動産
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	120	-	-	-	素材
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	150	300	265	4,720	不動産
JIANGXI COPPER CO LTD-H	140	200	220	3,925	素材
CHINA GAS HOLDINGS LTD	432	796	736	13,091	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,380	6,460	2,312	41,119	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	60	105	250	4,461	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	420	860	322	5,734	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MINTH GROUP LTD	100	220	435	7,744	自動車・自動車部品
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	120	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	340	660	412	7,334	ソフトウェア・サービス
YIHA! INTERNATIONAL HOLDING	60	90	189	3,368	食品・飲料・タバコ
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	320	700	290	5,165	自動車・自動車部品
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,980	-	-	-	小売
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	210	445	773	13,751	資本財
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	246	324	289	5,155	各種金融
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	200	540	140	2,505	資本財
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	120	320	184	3,282	運輸
SHENZHEN INVESTMENT LTD	420	-	-	-	不動産
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	190	190	153	2,732	資本財
FOSUN INTERNATIONAL LTD	315	720	418	7,437	資本財
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	80	120	171	3,046	小売
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	200	440	206	3,676	運輸
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	120	210	299	5,324	ソフトウェア・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	771	1,542	44,070	783,571	メディア・娯楽
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	260	-	-	-	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	210	540	1,042	18,530	不動産
XIAOMI CORP-CLASS B	1,922	3,770	3,758	66,829	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIR CHINA LTD-H	320	560	333	5,924	運輸
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	110	133.1	126	2,245	不動産
ZTE CORP-H	102	166	271	4,828	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	185	185	67	1,200	不動産

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	620	960	178	3,174	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	260	520	747	13,295	公益事業
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	90	157	284	5,058	ヘルスケア機器・サービス
PETROCHINA CO LTD-H	2,980	5,200	1,809	32,174	エネルギー
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	170	270	278	4,944	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN-CLASS B	540	1,089	16,923	300,892	小売
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	85	165	621	11,045	小売
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	120	-	-	-	消費者サービス
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,033	3,746	29,499	524,505	小売
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	200	495	308	5,491	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	440	1,140	421	7,499	公益事業
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	480	885	4,332	77,024	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	175	325	910	16,179	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	450	870	809	14,401	公益事業
LOGAN GROUP CO LTD	160	-	-	-	不動産
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	420	1,040	130	2,311	不動産
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,150	1,960	919	16,344	銀行
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	210	490	228	4,059	小売
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	12,880	23,790	11,228	199,649	銀行
CHINA FEIHE LTD	500	980	563	10,019	食品・飲料・タバコ
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	14	25	180	3,200	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JD.COM INC - CL A	-	534.35	11,264	200,275	小売
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	222	354	264	4,708	保険
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	660	1,200	1,066	18,967	半導体・半導体製造装置
NETEASE INC	-	511	5,605	99,668	メディア・娯楽
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	47	275	1,815	32,270	小売
HAIER SMART HOME CO LTD-H	302	566	1,437	25,561	耐久消費財・アパレル
KUAISHOU TECHNOLOGY	37	431	2,361	41,994	メディア・娯楽
CHINA TOWER CORP LTD-H	5,780	11,080	908	16,154	電気通信サービス
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,200	2,200	752	13,377	銀行
WUXI APPTEC CO LTD-H	44.11	87.11	645	11,484	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	50	120	72	1,295	ソフトウェア・サービス
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	140	310	513	9,127	消費者サービス
WEIMOB INC	210	-	-	-	ソフトウェア・サービス
CHINA YOUZAN LTD	1,720	-	-	-	ソフトウェア・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	-	375	778	13,835	消費者サービス
POP MART INTERNATIONAL GROUP	-	118	181	3,222	小売
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	100	-	-	-	不動産
HENGAN INTL GROUP CO LTD	80	150	516	9,174	家庭用品・パーソナル用品
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	90	160	279	4,967	消費者サービス
NONGFU SPRING CO LTD-H	44	448	1,953	34,729	食品・飲料・タバコ
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	240	400	176	3,129	運輸

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
BAIDU INC-CLASS A	—	543.5	5,334	94,846	メディア・娯楽
BILIBILI INC-CLASS Z	—	48.8	529	9,422	メディア・娯楽
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	460	835	1,928	34,294	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1,208	2,288	2,239	39,826	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOPHARM GROUP CO-H	188	332	592	10,542	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES LAND LTD	440	800	2,860	50,850	不動産
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	130	298	111	1,986	資本財
YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	200	380	936	16,654	エネルギー
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	120	249	661	11,754	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LTD	240	380	223	3,972	運輸
MMG LTD	320	800	162	2,887	素材
BYD CO LTD-H	105	205	3,731	66,337	自動車・自動車部品
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,400	7,440	1,912	33,996	銀行
CHINA RESOURCES CEMENT	380	520	216	3,855	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	114	217	382	6,805	保険
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,270	1,740	452	8,043	保険
CITIC LTD	770	1,430	1,113	19,806	資本財
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	—	330	280	4,981	耐久消費財・アパレル
IND & COMM BK OF CHINA-H	7,550	14,060	5,455	96,994	銀行
CIFI HOLDINGS GROUP C-RTS	21	—	—	—	不動産
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	—	84	400	7,124	ヘルスケア機器・サービス
GDS HOLDINGS LTD-CL A	—	239	310	5,515	ソフトウェア・サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD	400	620	438	7,804	公益事業
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	490	945	2,017	35,872	不動産
CRRG CORP LTD - H	—	850	263	4,685	資本財
KWG GROUP HOLDINGS LTD	125	—	—	—	不動産
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	100	330	280	4,981	素材
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	70	130	244	4,354	資本財
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	120	210	161	2,875	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COAL ENERGY CO-H	—	510	354	6,311	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	429	784	624	11,095	運輸
YUEXIU PROPERTY CO LTD	176	296	290	5,157	不動産
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	801	1,311	344	6,130	銀行
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	990	1,700	518	9,218	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	90	135	241	4,291	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	140	308	2,699	47,999	耐久消費財・アパレル
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	150	230	212	3,774	資本財
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	80	160	1,126	20,027	食品・飲料・タバコ
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	104.18	162.18	136	2,419	資本財
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	392	812	430	7,651	自動車・自動車部品
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	112	204	1,364	24,265	耐久消費財・アパレル
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	130	—	—	—	素材

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	855	1,575	7,441	132,316	保険
CHINA MENGNIU DAIRY CO	430	800	2,644	47,010	食品・飲料・タバコ
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	920	1,700	1,331	23,666	保険
LI NING CO LTD	300	580	3,358	59,708	耐久消費財・アパレル
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	415	815	842	14,983	自動車・自動車部品
WEICHAI POWER CO LTD-H	240	460	452	8,039	資本財
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	260	510	181	3,219	資本財
CHINA POWER INTERNATIONAL	370	1,480	432	7,683	公益事業
SUNNY OPTICAL TECH	96	182	1,638	29,139	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	520	720	231	4,122	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	340	650	1,134	20,178	保険
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	77	166	214	3,807	ヘルスケア機器・サービス
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,000	1,890	2,199	39,115	保険
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	106	200	2,114	37,586	公益事業
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	210	370	216	3,848	素材
KUNLUN ENERGY CO LTD	580	1,060	607	10,799	公益事業
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	268	-	-	-	不動産
CHINA OILFIELD SERVICES-H	260	380	368	6,560	エネルギー
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	760	1,420	1,420	25,247	素材
LENOVO GROUP LTD	1,020	1,780	1,146	20,381	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	340	420	378	6,735	資本財
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	480	1,040	706	12,555	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,080	2,160	959	17,051	銀行
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	40	90	174	3,110	家庭用品・パーソナル用品
CHINA EVERGRANDE GROUP	270	660	92	1,642	不動産
FAR EAST HORIZON LTD	280	280	170	3,036	各種金融
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	120	-	-	-	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	240	-	-	-	銀行
SINOTRUK HONG KONG LTD	100	100	97	1,724	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	66	135	473	8,413	資本財
CHINA MERCHANTS BANK-H	525	980	3,753	66,735	銀行
BANK OF CHINA LTD-H	10,710	19,810	5,467	97,213	銀行
CMOG GROUP LTD-H	360	660	232	4,142	素材
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	440	720	257	4,570	耐久消費財・アパレル
CITIC SECURITIES CO LTD-H	330	480	728	12,955	各種金融
SUN ART RETAIL GROUP LTD	245	-	-	-	食品・生活必需品小売り
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	428	608	284	5,059	各種金融
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15	27	300	5,347	食品・飲料・タバコ
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	500	-	-	-	不動産
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	340	770	180	3,217	銀行
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	62.5	142.5	210	3,734	素材
A-LIVING SMART CITY SERVICES	70	182.5	168	2,998	不動産

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
INNOVENT BIOLOGICS INC	160	230	691	12,288	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
POLY PROPERTY SERVICES CO-H	12	—	—	—	不動産	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10	26	269	4,784	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	20	51	221	3,944	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	275	—	—	—	銀行	
GF SECURITIES CO LTD-H	170	272	300	5,348	各種金融	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	92	168	560	9,961	自動車・自動車部品	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	920	—	—	—	各種金融	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	67	149	283	5,033	保険	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	184	320	456	8,113	各種金融	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	30	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	50	90	172	3,075	半導体・半導体製造装置	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	34	84	535	9,513	素材	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	300	—	—	—	自動車・自動車部品	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	360	672	748	13,310	ヘルスケア機器・サービス	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	255	475	1,097	19,509	不動産	
BOC AVIATION LTD	35	61	355	6,328	資本財	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	250	—	—	—	不動産	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	310	470	332	5,916	素材	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180	340	182	3,240	不動産	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	160	300	574	10,209	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	140	—	—	—	不動産	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	61	135	250	4,459	小売	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	152	256	393	6,991	消費者サービス	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	180	—	—	—	不動産	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	100	—	—	—	消費者サービス	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	180	340	493	8,765	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	240	440	503	8,949	食品・飲料・タバコ	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	100	—	—	—	不動産	
AKESO INC - B	40	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	360	960	153	2,731	メディア・娯楽	
SEAZEN GROUP LTD	320	320	121	2,162	不動産	
3SBIO INC	170	305	247	4,397	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA LITERATURE LTD	54	122	329	5,856	メディア・娯楽	
DALI FOODS GROUP CO LTD	195	510	171	3,046	食品・飲料・タバコ	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	140	340	462	8,221	自動車・自動車部品	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	100	—	—	—	不動産	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	86	158	568	10,113	不動産	
小 計	株 数 金額	114,889.19	203,101.44	268,373	4,771,681	
	銘柄 数 <比率>	213銘柄	195銘柄	—	<18.0%>	
(台湾)	株 数	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
SILERGY CORP	銘柄	10	88	4,109	18,452	半導体・半導体製造装置



エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	174.63	338.36	6,513	29,246	各種金融
ADVANTECH CO LTD	52.99	112.99	3,610	16,209	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	—	20	3,200	14,368	資本財
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	30	40	1,800	8,082	耐久消費財・アパレル
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	20	40	1,166	5,235	耐久消費財・アパレル
GLOBALWAFERS CO LTD	30	50	2,325	10,439	半導体・半導体製造装置
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	450	830	7,918	35,554	半導体・半導体製造装置
PARADE TECHNOLOGIES LTD	—	20	1,564	7,022	半導体・半導体製造装置
WIWYNN CORP	10	20	1,736	7,794	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOMO.COM INC	10	12	722	3,243	小売
EMEMORY TECHNOLOGY INC	—	20	2,910	13,066	半導体・半導体製造装置
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	—	800	2,608	11,710	半導体・半導体製造装置
TAIWAN CEMENT	670.77	1,496.76	5,021	22,548	素材
ASIA CEMENT CORP	290	570	2,339	10,506	素材
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	650	1,190	7,830	35,159	食品・飲料・タバコ
FORMOSA PLASTICS CORP	520	1,050	9,334	41,913	素材
NAN YA PLASTICS CORP	710	1,210	9,280	41,672	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	490	870	6,438	28,907	素材
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	350	790	2,539	11,404	資本財
WALSIN LIHWA CORP	—	550	2,499	11,224	資本財
CHINA STEEL CORP	1,580	2,990	8,581	38,531	素材
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	32.14	—	—	—	資本財
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	210	440	1,520	6,826	自動車・自動車部品
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	40	70	4,473	20,084	小売
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	310	490	3,214	14,433	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,590	2,920	13,037	58,542	半導体・半導体製造装置
DELTA ELECTRONICS INC	260	480	14,304	64,227	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,678	3,078	30,780	138,208	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	530	880	1,892	8,495	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YAGEO CORPORATION	51.98	89.12	3,903	17,527	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,300	6,080	296,096	1,329,530	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	450	610	1,296	5,820	半導体・半導体製造装置
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70	120	3,216	14,440	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	160	280	1,612	7,241	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC	340	610	1,500	6,737	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	110	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVENTEC CORP	420	720	1,778	7,985	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASUSTEK COMPUTER INC	100	170	4,539	20,381	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	80	140	1,708	7,669	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	60	110	3,459	15,533	半導体・半導体製造装置
QUANTA COMPUTER INC	370	700	5,005	22,473	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	140	260	1,487	6,677	半導体・半導体製造装置

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
AUO CORP	1,070	1,616	2,609	11,718	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	510	960	10,752	48,278	電気通信サービス
MEDIATEK INC	200	370	26,381	118,455	半導体・半導体製造装置
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	90	180	3,258	14,629	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVERGREEN MARINE CORP LTD	337.4	250.96	4,040	18,142	運輸
YANG MING MARINE TRANSPORT	210	430	2,799	12,569	運輸
CHINA AIRLINES LTD	—	630	1,143	5,134	運輸
WAN HAI LINES LTD	77	146.05	1,090	4,898	運輸
EVA AIRWAYS CORP	—	590	1,669	7,497	運輸
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	657.54	997.41	1,720	7,725	銀行
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	237.45	—	—	—	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,058.55	2,189.7	4,893	21,974	銀行
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	990	1,879.5	11,201	50,298	保険
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,070	2,000	8,690	39,019	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,820	3,811.96	5,031	22,593	保険
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,622.01	3,246.69	7,954	35,716	銀行
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,311.6	2,462.84	5,541	24,881	各種金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,470	2,817	8,873	39,844	銀行
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,259.58	2,656.47	3,984	17,892	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,484.32	3,234.32	2,862	12,852	保険
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,247.6	2,527.37	4,486	20,143	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,520	4,430	10,122	45,452	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,397.92	2,611.47	6,842	30,722	銀行
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	80	130	3,490	15,673	食品・生活必需品小売り
LARGAN PRECISION CO LTD	10.8	24.8	5,629	25,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	80	140	4,102	18,418	半導体・半導体製造装置
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	160	310	4,681	21,018	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	220	430	4,042	18,149	電気通信サービス
WISTRON CORP	352.93	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INNOLUX CORP	1,180	2,425.4	2,995	13,449	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD	245.2	335.2	1,583	7,111	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	220	360	2,401	10,781	電気通信サービス
PEGATRON CORP	270	530	3,259	14,635	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	120	190	1,582	7,106	半導体・半導体製造装置
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,281.05	2,421.08	6,415	28,808	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	100	—	—	—	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	140	240	2,028	9,106	エネルギー
WALSIN TECHNOLOGY CORP	40	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	290	410	1,164	5,228	運輸
WIN SEMICONDUCTORS CORP	40	60	930	4,175	半導体・半導体製造装置
ONENESS BIOTECH CO LTD	30	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	5	5	369	1,659	半導体・半導体製造装置

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	482.99	882.99	4,220	18,951	銀行	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	30	60	1,602	7,193	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
E INK HOLDINGS INC	—	220	3,894	17,484	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PHISON ELECTRONICS CORP	20	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
POU CHEN	260	540	1,744	7,831	耐久消費財・アパレル	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	56.4	106.4	2,021	9,077	耐久消費財・アパレル	
GIANT MANUFACTURING	40	70	1,617	7,260	耐久消費財・アパレル	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	121.8	362.7	1,664	7,475	不動産	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	20	30	2,727	12,244	資本財	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	70	140	1,666	7,480	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	42,957.65 87銘柄	81,816.54 87銘柄	690,654 —	3,101,177 <11.7%>	
(エジプト)		百株	百株	千エジプト・ポンド	千円	
EASTERN CO SAE	135.58	135.58	188	1,064	1,064	食品・飲料・タバコ
COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	221.49	559.39	2,228	12,591	12,591	銀行
FAWRY FOR BANKING & PAYMENT	53.9	—	—	—	—	ソフトウェア・サービス
EFG-HERMES HOLDING SAE	—	159.25	227	1,283	1,283	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	410.97 3銘柄	854.22 3銘柄	2,644 —	14,940 <0.1%>	
(トルコ)		百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	84.52	192.91	902	6,719	6,719	資本財
HACI OMER SABANCI HOLDING	—	271.03	1,099	8,193	8,193	銀行
TURKIYE GARANTI BANKASI	354.53	—	—	—	—	銀行
AKBANK T. A. S.	393.34	707.66	1,249	9,310	9,310	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C	223.89	862.59	887	6,612	6,612	銀行
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	155.66	270.8	926	6,899	6,899	電気通信サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	15.04	26.5	1,285	9,574	9,574	エネルギー
TURK HAVA YOLLARI AO	—	130.66	1,574	11,729	11,729	運輸
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	224.34	397.92	1,543	11,495	11,495	資本財
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	9.47	16.88	747	5,568	5,568	自動車・自動車部品
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	197.52	388.81	1,627	12,124	12,124	素材
KOC HOLDING AS	91.07	155.38	1,100	8,195	8,195	資本財
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	57.02	121.75	1,636	12,190	12,190	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	1,806.4 11銘柄	3,542.89 12銘柄	14,579 —	108,613 <0.4%>	
(メキシコ)		百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
BECLE SAB DE CV	60	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ
OPERADORA DE SITIOS MEX- A-1	—	304	655	4,733	4,733	電気通信サービス
SITIOS LATINOAMERICA SAB DE	—	348.55	285	2,059	2,059	電気通信サービス
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	30.5	51.05	856	6,188	6,188	運輸
TELESITES SAB DE CV	147	—	—	—	—	電気通信サービス
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	50	89	2,666	19,256	19,256	運輸

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	4,595	6,971	12,993	93,844	電気通信サービス	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	176	319	1,042	7,526	家庭用品・パーソナル用品	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	711	1,315	9,517	68,740	食品・生活必需品小売り	
GRUMA S. A. B. -B	24.65	50.5	1,169	8,447	食品・飲料・タバコ	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	16.95	30.95	797	5,760	素材	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	77	111	917	6,624	資本財	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	432	770	5,558	40,145	素材	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	282	531	1,893	13,675	銀行	
ALFA S. A. B. -A	-	839	1,111	8,028	資本財	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	117	203	751	5,427	素材	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	196	329	2,687	19,408	食品・飲料・タバコ	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	70	109	1,753	12,664	食品・飲料・タバコ	
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	26.55	47.8	2,188	15,807	運輸	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	347	653	9,771	70,571	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,358.65 17銘柄	13,071.85 18銘柄	56,618 -	408,911 <1.5%>	
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円		
AYALA LAND INC	1,176	1,980	6,237	15,301	不動産	
CONVERGE INFORMATION AND COM	-	474	732	1,797	電気通信サービス	
PLDT INC	12.55	20.05	3,512	8,618	電気通信サービス	
ACEN CORP	-	1,416.8	1,007	2,471	公益事業	
MONDE NISSIN CORP	-	1,557	1,968	4,828	食品・飲料・タバコ	
METROPOLITAN BANK & TRUST	242.4	389.8	2,233	5,479	銀行	
MANILA ELECTRIC COMPANY	23.4	51.2	1,433	3,517	公益事業	
SM PRIME HOLDINGS INC	1,314	2,848	10,366	25,433	不動産	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	225.27	492.27	5,213	12,789	銀行	
AYALA CORPORATION	37.9	67.5	4,698	11,526	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORP	74.8	128.3	3,143	7,711	消費者サービス	
UNIVERSAL ROBINA CORP	101.8	172.3	2,291	5,622	食品・飲料・タバコ	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	117.7	231.3	4,741	11,633	運輸	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	266.5	420.9	2,525	6,195	資本財	
GLOBE TELECOM INC	3.35	6.2	1,426	3,498	電気通信サービス	
SM INVESTMENTS CORP	32.05	54.05	5,075	12,451	資本財	
BDO UNIBANK INC	286.7	520.7	6,774	16,620	銀行	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	1,109	1,109	383	941	各種金融	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	13.1	13.1	575	1,410	資本財	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	402.82	825.62	4,053	9,945	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,439.34 17銘柄	12,778.09 20銘柄	68,393 -	167,795 <0.6%>	
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円		
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	-	3,740.56	26,183	4,022	運輸	
CENCOSUD SHOPPING SA	55.23	-	-	-	不動産	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
ENEL CHILE SA	3,648.77	3,648.77	14,777	2,270	公益事業	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	6.71	10.84	26,568	4,081	銀行	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	15.86	15.86	8,723	1,339	食品・飲料・タバコ	
BANCO DE CHILE	6,086.4	10,243.25	85,684	13,162	銀行	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	18.3	36.01	310,586	47,709	素材	
ENEL AMERICAS SA	2,637.07	6,005.05	71,460	10,977	公益事業	
CENCOSUD SA	183.17	400.71	52,497	8,064	食品・生活必需品小売り	
FALABELLA SA	101.23	159.11	24,741	3,800	小売	
COLBUN SA	1,241.12	—	—	—	公益事業	
EMPRESAS CMPC SA	130.85	225.43	33,226	5,103	素材	
EMPRESAS COPEC SA	58.18	105.29	63,542	9,760	エネルギー	
BANCO SANTANDER CHILE	10,029.9	18,250.75	62,508	9,602	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	24,212.79 13銘柄	42,841.63 12銘柄	780,500 —	119,894 <0.5%>	
(コロンビア)	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円		
ECOPETROL SA	616.93	1,345.24	332,946	9,606	エネルギー	
BANCOLOMBIA SA	36.56	59.94	243,955	7,038	銀行	
BANCOLOMBIA SA-PREF	55.54	122.17	378,604	10,923	銀行	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	59.33	81.1	154,738	4,464	公益事業	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	29.86	—	—	—	各種金融	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	798.22 5銘柄	1,608.45 4銘柄	1,110,246 —	32,032 <0.1%>	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円		
YES BANK LTD	1,118.06	2,778.99	4,738	8,102	銀行	
IPCA LABORATORIES LTD	9.18	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INFOSYS LTD	456.4	834.06	135,872	232,342	ソフトウェア・サービス	
BHARAT ELECTRONICS LTD	191.31	900.96	9,563	16,353	資本財	
HAVELLS INDIA LTD	30.11	57.14	7,055	12,065	資本財	
VEDANTA LTD	149.89	155.67	4,698	8,035	素材	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	109.03	234.4	13,708	23,442	保険	
TECH MAHINDRA LTD	81.14	143.79	15,450	26,421	ソフトウェア・サービス	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	48.42	75.42	3,553	6,075	保険	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	60.7	110.98	13,965	23,881	保険	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	—	68.19	4,930	8,430	商業・専門サービス	
ZOMATO LTD	—	582.11	3,699	6,325	小売	
MPHASIS LTD	—	17.73	3,552	6,074	ソフトウェア・サービス	
SRF LTD	—	33.36	7,742	13,239	素材	
GODREJ PROPERTIES LTD	—	30.83	3,941	6,740	不動産	
TATA ELXSI LTD	—	8.44	5,723	9,787	ソフトウェア・サービス	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	—	33.04	2,072	3,544	銀行	
SHREE CEMENT LTD	1.46	2.95	6,849	11,712	素材	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	80.79	136.3	10,972	18,763	食品・飲料・タバコ	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
MRF LTD	0.21	0.47	4,350	7,439	自動車・自動車部品
INDIAN OIL CORP LTD	290.88	665.26	5,009	8,566	エネルギー
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	9.71	19.06	3,878	6,632	自動車・自動車部品
DIVI'S LABORATORIES LTD	17.9	32.72	11,035	18,870	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUROBINDO PHARMA LTD	36.11	64.99	3,032	5,185	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOCON LTD	46.86	102.92	2,903	4,964	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PETRONET LNG LTD	88.94	184.86	3,916	6,696	エネルギー
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	14.4	—	—	—	各種金融
BHARAT FORGE LTD	34.65	53.74	4,561	7,799	自動車・自動車部品
PIDILITE INDUSTRIES LTD	20.56	39.91	10,887	18,617	素材
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	5.56	25.03	4,092	6,998	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INFO EDGE INDIA LTD	10.41	17.49	6,928	11,846	メディア・娯楽
PAGE INDUSTRIES LTD	0.82	1.51	7,110	12,159	耐久消費財・アパレル
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	73.91	130.18	11,432	19,549	運輸
JUBILANT FOODWORKS LTD	10.66	93.93	5,129	8,770	消費者サービス
MUTHOOT FINANCE LTD	13.43	29.68	3,226	5,517	各種金融
PI INDUSTRIES LTD	10.67	18.69	6,307	10,786	素材
BAJAJ FINANCE LTD	36.47	67.16	45,226	77,337	各種金融
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	6.27	22.46	11,032	18,865	ソフトウェア・サービス
ADANI GREEN ENERGY LTD	51.36	78.09	15,712	26,867	公益事業
INDRAPRASTHA GAS LTD	41.21	66.11	2,865	4,900	公益事業
TRENT LTD	20.23	43.08	6,276	10,732	小売
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	7.18	—	—	—	各種金融
BANDHAN BANK LTD	100.02	135.22	3,166	5,414	銀行
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	14.62	26.72	11,450	19,580	食品・飲料・タバコ
EICHER MOTORS LTD	18.26	33.7	11,512	19,685	自動車・自動車部品
BERGER PAINTS INDIA LTD	27.09	69.33	4,244	7,257	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD	21.84	39.92	15,828	27,067	食品・生活必需品小売り
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	29.89	59.3	6,971	11,921	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	12.71	20.35	3,889	6,651	運輸
ADANI TOTAL GAS LTD	40.19	67.78	24,400	41,725	公益事業
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	62.81	101.22	7,234	12,371	各種金融
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	27.87	49.49	4,044	6,916	各種金融
ADANI TRANSMISSION LTD	40.01	70.36	19,579	33,480	公益事業
TATA STEEL LTD	93.84	1,806.37	19,165	32,773	素材
CIPLA LTD	65.26	119.34	13,379	22,879	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXIS BANK LTD	305.68	568.86	50,773	86,822	銀行
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	18.33	29.79	26,543	45,389	自動車・自動車部品
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	13.65	25.69	4,117	7,040	家庭用品・パーソナル用品
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	340.64	620.21	8,698	14,874	エネルギー
ACC LTD	10.19	16.28	4,092	6,998	素材
AMBUJA CEMENTS LTD	93.73	162.48	9,179	15,696	素材

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ITC LTD	417.84	729.09	24,956	42,676	食品・飲料・タバコ
TATA POWER CO LTD	—	354.46	7,920	13,543	公益事業
DLF LTD	85.19	152.55	5,988	10,240	不動産
ASIAN PAINTS LTD	51.75	95.11	29,817	50,987	素材
NESTLE INDIA LTD	4.52	8.32	16,740	28,626	食品・飲料・タバコ
HINDUSTAN UNILEVER LTD	109.78	205.15	54,040	92,409	家庭用品・パーソナル用品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	74.13	157.34	3,752	6,416	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	228.5	440	26,776	45,787	銀行
ICICI BANK LTD	680.18	1,275.6	120,767	206,512	銀行
RELIANCE INDUSTRIES LTD	380.5	752.44	204,076	348,971	エネルギー
SIEMENS LTD	11.67	14.95	4,154	7,103	資本財
NTPC LTD	690.36	956.15	16,268	27,819	公益事業
UNITED SPIRITS LTD	39.2	71.65	6,501	11,118	食品・飲料・タバコ
JSW STEEL LTD	113.53	187.89	13,763	23,536	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	447.52	773.78	16,972	29,023	公益事業
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	38.01	65.93	5,008	8,564	運輸
TITAN CO LTD	46.25	87.54	22,880	39,126	耐久消費財・アパレル
BAJAJ FINSERV LTD	4.87	94.1	15,357	26,260	各種金融
BAJAJ AUTO LTD	9.49	16.01	5,859	10,020	自動車・自動車部品
BHARTI AIRTEL LTD	330.9	550.35	46,001	78,661	電気通信サービス
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	106.59	213.9	7,252	12,401	エネルギー
DR. REDDY'S LABORATORIES	15.14	28.72	12,790	21,870	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GAIL INDIA LTD	206.78	489.27	4,606	7,877	公益事業
GRASIM INDUSTRIES LTD	33.91	64.76	11,133	19,037	素材
HCL TECHNOLOGIES LTD	146.4	267.58	30,208	51,656	ソフトウェア・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	231.02	427.46	113,928	194,818	各種金融
HERO MOTOCORP LTD	16.17	27.09	7,661	13,101	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	212.1	345.96	15,082	25,790	素材
LARSEN & TOUBRO LTD	92.15	173.09	35,492	60,692	資本財
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	117.37	216.36	27,198	46,509	自動車・自動車部品
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	109.32	236.58	24,837	42,471	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	124.72	225.5	76,610	131,003	ソフトウェア・サービス
TATA MOTORS LTD	219.98	409.31	17,729	30,317	自動車・自動車部品
WIPRO LTD	183.4	336.78	13,644	23,332	ソフトウェア・サービス
JINDAL STEEL & POWER LTD	—	85.61	4,408	7,539	素材
MARICO LTD	65.77	139.55	7,010	11,988	食品・飲料・タバコ
ULTRATECH CEMENT LTD	14.18	24.91	17,259	29,514	素材
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	74.81	137.04	26,387	45,123	銀行
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	13.57	24.81	11,708	20,021	ヘルスケア機器・サービス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	48.27	107.73	9,325	15,946	家庭用品・パーソナル用品
LUPIN LTD	31.51	48.61	3,652	6,246	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	170.36	501.06	3,672	6,280	自動車・自動車部品

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	25.6	46.68	5,929	10,139	各種金融	
UPL LTD	72.08	128.73	9,974	17,056	素材	
DABUR INDIA LTD	83.43	163.54	9,699	16,586	家庭用品・パーソナル用品	
REC LTD	99.15	—	—	—	各種金融	
ADANI ENTERPRISES LTD	40.24	70.25	27,245	46,590	資本財	
ADANI POWER LTD	—	190.15	6,174	10,557	公益事業	
COAL INDIA LTD	207.79	379.79	8,628	14,755	エネルギー	
INDUS TOWERS LTD	96.51	168.9	3,368	5,760	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	11,144.03 101銘柄	24,652.24 107銘柄	1,881,512 —	3,217,386 <12.1%>	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円		
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	132	—	—	—	素材	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	212	711	709,222	6,312	食品・飲料・タバコ	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,189	1,189	273,470	2,433	電気通信サービス	
BANK JAGO TBK PT	—	1,025	480,725	4,278	銀行	
SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	—	4,101	1,164,684	10,365	食品・生活必需品小売り	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,045	1,827	858,690	7,642	家庭用品・パーソナル用品	
ADARO MINERALS INDONESIA TBK	—	1,716	281,424	2,504	素材	
UNITED TRACTORS TBK PT	193	387	1,188,090	10,574	エネルギー	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,556	5,160	3,121,800	27,784	自動車・自動車部品	
GUDANG GARAM TBK PT	40	108	231,660	2,061	食品・飲料・タバコ	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	435	912	693,120	6,168	素材	
KALBE FARMA TBK PT	2,461	5,200	1,092,000	9,718	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,129	1,754	1,021,705	9,093	食品・飲料・タバコ	
VALE INDONESIA TBK	—	521	380,330	3,384	素材	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	513	877	554,702	4,936	食品・飲料・タバコ	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	6,927	12,297	4,894,206	43,558	電気通信サービス	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,037	1,839	1,724,062	15,344	銀行	
ANEKA TAMBANG TBK	1,280	1,280	251,520	2,238	素材	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	7,480	13,820	12,403,450	110,390	銀行	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	2,656	4,602	4,751,565	42,288	銀行	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	9,130	17,091	8,289,135	73,773	銀行	
ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	2,639	3,548	1,376,624	12,251	エネルギー	
BARITO PACIFIC TBK PT	3,642	6,268	507,708	4,518	素材	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	297	575	560,625	4,989	素材	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,839	5,165	591,392	5,263	電気通信サービス	
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,797	3,251.61	1,336,411	11,894	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	49,629 22銘柄	95,224.61 25銘柄	48,738,322 —	433,771 <1.6%>	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円		
AMBEV SA	654	1,165	1,836	48,236	食品・飲料・タバコ	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	86	173	534	14,039	保険	



エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
WEG SA	224.6	413.6	1,559	40,975	資本財
ATACADAO SA	81	142	223	5,871	食品・生活必需品小売り
VIBRA ENERGIA SA	156.8	286.8	469	12,326	小売
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	170	1,144.19	593	15,601	ヘルスケア機器・サービス
MAGAZINE LUIZA SA	410	749	251	6,611	小売
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	67	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
PETRO RIO SA	—	174	613	16,127	エネルギー
BANCO BRADESCO S. A.	179.38	394.81	526	13,836	銀行
SUZANO SA	106.15	193.15	1,029	27,051	素材
ALPARGATAS SA - PREF	21	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LOCALIZA RENT A CAR	79	189.3	1,143	30,048	運輸
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	106	176	241	6,353	エネルギー
TOTVS SA	66	129	376	9,899	ソフトウェア・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	112	228	625	16,430	公益事業
TELEFONICA BRASIL S. A.	69	113	434	11,411	電気通信サービス
VIA S/A	140	—	—	—	小売
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	25.5	42.5	166	4,386	公益事業
NATURA &CO HOLDING SA	121	221	254	6,682	家庭用品・パーソナル用品
TIM SA	111	182	238	6,273	電気通信サービス
RUMO SA	156	340	661	17,382	運輸
REDE D'OR SAO LUIZ SA	54	99	299	7,862	ヘルスケア機器・サービス
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	638	1,174	2,979	78,280	エネルギー
BANCO BRADESCO SA-PREF	658.06	1,335.36	2,071	54,412	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	85	146	209	5,504	素材
VALE SA	531	986.88	8,333	218,929	素材
GERDAU SA-PREF	164	299	927	24,367	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	498	917	2,694	70,780	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	139.46	342.99	391	10,281	公益事業
ITAUSA SA	623.8	1,258.05	1,105	29,052	銀行
BRASKEM SA-PREF A	26	40	116	3,068	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	31	57	279	7,343	公益事業
BRADESPAR SA -PREF	32.75	—	—	—	素材
BANCO DO BRASIL S. A.	106	212	747	19,632	銀行
COSAN SA	126.88	299.88	517	13,606	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	38	268.05	1,246	32,760	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	110	—	—	—	公益事業
CCR SA	138	327	384	10,094	運輸
BRF SA	99	150	150	3,944	食品・飲料・タバコ
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	39	93	556	14,620	公益事業
CPFL ENERGIA SA	24	48	163	4,302	公益事業
LOJAS RENNER S. A.	140.58	243.58	559	14,692	小売
JBS SA	118	184	413	10,857	食品・飲料・タバコ

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	820	1,536	1,927	50,643	各種金融	
HYPERA SA	60	101	448	11,784	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RAIA DROGASIL SA	143	242	543	14,285	食品・生活必需品小売り	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	649	1,210	3,114	81,824	銀行	
AMERICANAS SA	52.75	130.24	133	3,503	小売	
小計	株数・金額 銘柄数〈比率〉	9,286.71 48銘柄	18,156.38 44銘柄	42,097 —	1,105,985 〈4.2%〉	
(チェコ)	百株	百株	千チェコ・コルナ	千円		
MONETA MONEY BANK AS	47.9	47.9	343	2,027	銀行	
CEZ AS	20.68	41.77	3,360	19,812	公益事業	
KOMERCNI BANKA AS	9.34	18.21	1,257	7,413	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数〈比率〉	77.92 3銘柄	107.88 3銘柄	4,961 —	29,253 〈0.1%〉	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円		
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	—	9.69	42,345	4,437	保険	
HANMI PHARM CO LTD	0.87	1.71	43,861	4,596	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
YUHAN CORP	7.6	12.26	70,372	7,375	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CJ LOGISTICS	0.74	2.35	21,737	2,278	運輸	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	9.63	21.14	71,981	7,543	自動車・自動車部品	
KIA CORP	35.28	64.95	437,113	45,809	自動車・自動車部品	
NETMARBLE CORP	3.37	3.37	16,580	1,737	メディア・娯楽	
HD HYUNDAI	5.7	13.4	86,832	9,099	エネルギー	
DOUZONE BIZON CO LTD	1.9	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1.91	5.26	34,821	3,649	素材	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	—	8.24	30,158	3,160	各種金融	
SK HYNIX INC	73.1	134.59	1,126,518	118,059	半導体・半導体製造装置	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9.21	18.49	75,069	7,867	資本財	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3.78	7.59	155,215	16,266	保険	
KAKAOBANK CORP	7	24.98	62,574	6,557	銀行	
ECOPRO BM CO LTD	1.47	12.9	142,545	14,938	資本財	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2.56	5.5	44,385	4,651	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SK SQUARE CO LTD	2.27	27.13	99,431	10,420	半導体・半導体製造装置	
KAKAO GAMES CORP	—	7.34	31,231	3,273	メディア・娯楽	
SD BIOSENSOR INC	—	6.04	19,901	2,085	ヘルスケア機器・サービス	
KRAFTON INC	—	6.5	142,350	14,918	メディア・娯楽	
F&F CO LTD / NEW	—	5.02	75,049	7,865	耐久消費財・アパレル	
ILJIN MATERIALS CO LTD	—	3.85	23,523	2,465	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LG ENERGY SOLUTION	—	6	340,200	35,652	資本財	
CJ CORP	1.68	4.98	38,296	4,013	資本財	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	—	4.48	51,072	5,352	資本財	
AMOREPACIFIC GROUP	4.73	4.73	15,609	1,635	家庭用品・パーソナル用品	
POSCO CHEMICAL CO LTD	4.61	6.41	142,622	14,946	素材	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	
			外貨建金額 邦貨換算金額	
SHINSEGAE INC	1.2	—	—	小売
HYUNDAI MOTOR CO	18.61	34.24	578,656	自動車・自動車部品
POSCO HOLDINGS INC	10	19.34	567,629	素材
NH INVESTMENT & SECURITIES C	23.76	23.76	22,548	各種金融
GREEN CROSS CORP	0.79	0.79	10,704	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	8.91	13.73	32,608	資本財
SAMSUNG SDI CO LTD	7.37	13.71	984,378	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	44.96	84.57	56,069	各種金融
MERITZ SECURITIES CO LTD	55.28	55.28	31,177	各種金融
HOTEL SHILLA CO LTD	4.07	6.8	49,232	小売
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	7.94	13.81	185,744	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4.78	11.58	88,818	資本財
KOREA ZINC CO LTD	0.97	2.27	143,691	素材
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	66.68	144.96	74,799	資本財
S-OIL CORP	5.53	12.13	105,288	エネルギー
LG INNOTEK CO LTD	1.58	3.82	114,218	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LOTTE CHEMICAL CORP	2.07	3.6	66,600	素材
HMM CO LTD	36.18	71.25	155,681	運輸
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	2.27	5.31	79,915	素材
SKC CO LTD	2.81	4.96	54,312	素材
HYUNDAI MOBIS CO LTD	8.97	15.15	315,877	自動車・自動車部品
S-1 CORPORATION	2.19	2.19	14,059	商業・専門サービス
E-MART INC	2.37	5.16	47,420	食品・生活必需品小売り
HANON SYSTEMS	23.8	41.38	36,041	自動車・自動車部品
COWAY CO LTD	7.46	12.84	71,262	耐久消費財・アパレル
LOTTE SHOPPING CO	1.72	1.72	14,465	小売
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	40.84	54.67	60,410	銀行
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	20.75	43.16	105,957	資本財
PAN OCEAN CO LTD	45.27	45.27	24,219	運輸
CHEIL WORLDWIDE INC	11.93	11.93	28,632	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	31.03	45.55	54,432	電気通信サービス
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	10.2	21.48	151,863	保険
KT&G CORP	15.74	27.07	261,766	食品・飲料・タバコ
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	35.99	106.18	176,258	資本財
LG DISPLAY CO LTD	31.01	48.81	70,774	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK INC	4.53	9.61	207,095	資本財
KANGWON LAND INC	13.92	20.78	51,118	消費者サービス
NAVER CORP	16.49	32.8	598,600	メディア・娯楽
KAKAO CORP	41.6	78.11	436,634	メディア・娯楽
CJ ENM CO LTD	1.44	1.44	12,873	メディア・娯楽
NCSOFT CORP	2.28	4.06	184,527	メディア・娯楽
LG CORP	11.17	24.59	208,277	資本財

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	4.15	—	—	—	資本財
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	10.63	15.68	74,793	7,838	資本財
LG H&H	1.3	2.31	151,074	15,832	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	6.14	12.32	880,880	92,316	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	0.89	2.27	75,137	7,874	素材
HYUNDAI STEEL CO	10.44	18.21	61,094	6,402	素材
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	3.13	5.82	46,443	4,867	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	4.19	8.63	69,298	7,262	自動車・自動車部品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	59.22	113.8	425,043	44,544	銀行
KB FINANCIAL GROUP INC	53.28	96.57	498,301	52,221	銀行
DB INSURANCE CO LTD	5.07	9.12	55,905	5,858	保険
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	110.17	202.85	1,115,675	116,922	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG H&H-PRF	0.17	0.35	9,887	1,036	家庭用品・パーソナル用品
HLB INC	13.14	25.99	84,467	8,852	ヘルスケア機器・サービス
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	3.34	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLTRION PHARM INC	1.73	3.47	23,040	2,414	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FILA HOLDINGS CORP	6.2	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SEEGENE INC	4.08	7.13	23,671	2,480	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BGF RETAIL CO LTD	0.61	1.93	38,407	4,025	食品・生活必需品小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3.73	6.94	80,504	8,436	食品・飲料・タバコ
SK CHEMICALS CO LTD	1.44	1.44	13,651	1,430	素材
WOORI FINANCIAL GROUP INC	66.54	134.59	170,256	17,842	銀行
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3.83	6.57	47,961	5,026	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG SDS CO LTD	4.28	9.42	116,808	12,241	ソフトウェア・サービス
ALTEOGEN INC	3.12	8.82	33,383	3,498	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG C&T CORP	10.79	21.63	261,723	27,428	資本財
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2.21	4.52	400,020	41,922	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PEARL ABYSS CORP	3.99	4.98	21,812	2,285	メディア・娯楽
DOOSAN BOBCAT INC	6.64	12.93	53,465	5,603	資本財
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	11.27	22.95	148,486	15,561	ヘルスケア機器・サービス
HYBE CO LTD	1.82	4.59	66,096	6,926	メディア・娯楽
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	639.41	1,177.29	7,134,377	747,682	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG ELECTRONICS INC	14.77	26.22	245,943	25,774	耐久消費財・アパレル
L&F CO LTD	—	5.76	124,992	13,099	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELLTRION INC	12.93	24.86	438,779	45,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	5.76	8.73	49,935	5,233	各種金融
KOREA ELECTRIC POWER CORP	34.02	57.78	117,004	12,262	公益事業
GS HOLDINGS	6.28	11.78	54,835	5,746	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	23.28	47.01	118,465	12,415	運輸
SK TELECOM	3.52	—	—	—	電気通信サービス
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2.34	5.24	90,390	9,472	運輸
HANA FINANCIAL GROUP	41.9	72.94	319,112	33,442	銀行

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	9.82	13.12	46,116	4,833	各種金融
AMOREPACIFIC CORP	4.19	8.08	105,040	11,008	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD	6.82	13.68	239,400	25,089	エネルギー
CJ CHEILJEDANG CORP	1.25	1.74	67,773	7,102	食品・飲料・タバコ
HANWHA SOLUTIONS CORP	14.76	26.23	136,920	14,349	素材
小 計	株 数 銘 柄 数 <比率>	2,102.46 107銘柄	3,875.05 111銘柄	24,312,416 —	2,547,941 < 9.6%>
(マレーシア)		百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円
WESTPORTS HOLDINGS BHD	100	—	—	—	運輸
MISC BHD	196	285	205	6,318	運輸
SIME DARBY PLANTATION BHD	239	593	257	7,942	食品・飲料・タバコ
MR DIY GROUP M BHD	—	634.5	126	3,907	小売
PETRONAS DAGANGAN BHD	30	73	163	5,034	エネルギー
MALAYAN BANKING BHD	535	1,220	1,061	32,680	銀行
GENTING BHD	258	602	266	8,211	消費者サービス
PUBLIC BANK BERHAD	1,963	3,666	1,616	49,777	銀行
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	19	57	108	3,334	銀行
SIME DARBY BERHAD	471	471	103	3,190	資本財
AXIATA GROUP BERHAD	326	529	163	5,032	電気通信サービス
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	50	86	181	5,597	食品・飲料・タバコ
TOP GLOVE CORP BHD	765	979	85	2,637	ヘルスケア機器・サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	348	632	538	16,579	素材
GENTING MALAYSIA BHD	438	731	194	5,986	消費者サービス
TELEKOM MALAYSIA BHD	160	340	189	5,841	電気通信サービス
IOI CORP BHD	318	706	273	8,434	食品・飲料・タバコ
AMMB HOLDINGS BHD	170	393	161	4,985	銀行
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	926	1,728	1,005	30,965	銀行
TENAGA NASIONAL BHD	331	676	609	18,774	公益事業
PPB GROUP BERHAD	90.4	133.4	216	6,662	食品・飲料・タバコ
HONG LEONG BANK BERHAD	101	160	334	10,286	銀行
RHB BANK BHD	289	289	163	5,045	銀行
PETRONAS GAS BHD	106	216	361	11,119	公益事業
DIGI.COM BHD	388	864	335	10,321	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	147	147	92	2,837	運輸
MAXIS BHD	268	579	226	6,970	電気通信サービス
HAP SENG CONSOLIDATED	81	204	140	4,315	資本財
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12	—	—	—	食品・飲料・タバコ
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	9	15	195	6,022	食品・飲料・タバコ
QL RESOURCES BHD	130.5	292.5	161	4,980	食品・飲料・タバコ
DIALOG GROUP BHD	486	905	201	6,213	エネルギー
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	150	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SUPERMAX CORP BHD	169.68	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
HARTALEGA HOLDINGS BHD	231	377	66	2,042	ヘルスケア機器・サービス	
INARI AMERTRON BHD	—	529	143	4,413	半導体・半導体製造装置	
IHH HEALTHCARE BHD	275	417	248	7,639	ヘルスケア機器・サービス	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	392	821	394	12,133	素材	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	10,968.58 36銘柄	20,350.4 34銘柄	10,595 —	326,235 <1.2%>	
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
GOLD FIELDS LTD	114.57	229.32	4,233	34,541	素材	
MR PRICE GROUP LTD	32.42	63.31	1,054	8,607	小売	
PEPKOR HOLDINGS LTD	—	350.12	750	6,122	小売	
MULTICHOICE GROUP LTD	50.73	78.94	939	7,665	メディア・娯楽	
OLD MUTUAL LTD	635.04	1,160.7	1,269	10,361	保険	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48.13	83.1	1,562	12,748	素材	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	10.84	21.46	4,254	34,716	銀行	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	7.62	13.08	2,119	17,297	素材	
SPAR GROUP LIMITED/THE	25.98	41.8	572	4,672	食品・生活必需品小売り	
SIBANYE STILLWATER LTD	391.5	731.51	3,303	26,956	素材	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	94.57	—	—	—	保険	
BID CORP LTD	43.94	82.68	2,714	22,146	食品・生活必需品小売り	
VODACOM GROUP LTD	86.66	168.89	2,146	17,516	電気通信サービス	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	67.3	129.62	3,242	26,459	食品・生活必需品小売り	
NEDBANK GROUP LTD	70.81	113.48	2,553	20,835	銀行	
BIDVEST GROUP LTD	36.06	77.35	1,732	14,137	資本財	
STANDARD BANK GROUP LTD	174.79	330.94	5,889	48,060	銀行	
SASOL LTD	73.12	139.6	4,086	33,345	素材	
REMGRO LTD	65.63	130.46	1,855	15,137	各種金融	
DISCOVERY LTD	58.36	123.09	1,525	12,446	保険	
EXXARO RESOURCES LTD	35.3	60.27	1,351	11,024	エネルギー	
KUMBA IRON ORE LTD	8.36	15.88	745	6,086	素材	
SANLAM LTD	258.96	439.17	2,411	19,677	保険	
TIGER BRANDS LTD	23.04	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
FIRSTRAND LTD	675.93	1,244.51	8,094	66,049	各種金融	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	128.22	246.38	1,618	13,208	小売	
THE FOSCHINI GROUP LTD	—	69.46	724	5,909	小売	
ABSA GROUP LTD	97.19	198.53	4,013	32,753	銀行	
NASPERS LTD-N SHS	29.34	53.94	13,401	109,355	小売	
MTN GROUP LTD	227.04	428.37	5,823	47,521	電気通信サービス	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	106.82	209.59	4,222	34,453	素材	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	15.03	24.73	693	5,658	素材	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	52.33	93.93	1,340	10,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	85.44	116.45	695	5,678	素材	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	58.48	108.79	3,287	26,827	素材	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
CLICKS GROUP LTD	34.08	60.14	1,739	14,195	食品・生活必需品小売り	
NEPI ROCKCASTLE N.V.	58.44	112.59	1,141	9,316	不動産	
REINET INVESTMENTS SCA	16.81	28.79	876	7,149	各種金融	
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	3,998.88 36銘柄	7,580.97 36銘柄	97,988 —	799,585 < 3.0%>
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円		
SIAM CEMENT PCL-NVDR	108	192	6,528	25,655	素材	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	363	721	1,759	6,913	小売	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	366	727	2,199	8,642	消費者サービス	
SCB X PCL-NVDR	—	234	2,457	9,656	銀行	
JMT NETWORK SERVICES-NVDR	—	166	1,095	4,305	各種金融	
KASIKORN BANK PCL-NVDR	—	165	2,400	9,434	銀行	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	247	357	1,490	5,857	素材	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	127	—	—	—	銀行	
TRUE CORP PCL-NVDR	1,500	2,592	1,176	4,624	電気通信サービス	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	160	293	5,567	21,878	電気通信サービス	
KRUNG THAI BANK - NVDR	292	1,035	1,821	7,158	銀行	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,277	2,546	7,574	29,767	ヘルスケア機器・サービス	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	184	343	6,465	25,409	エネルギー	
RATCH GROUP PCL-NVDR	79	196	803	3,158	公益事業	
PTT PCL-NVDR	1,394	2,524	8,392	32,981	エネルギー	
THAI OIL PCL-NVDR	150	248	1,376	5,409	エネルギー	
CP ALL PCL-NVDR	811	1,487	9,442	37,108	食品・生活必需品小売り	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	550	1,056	7,867	30,918	運輸	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	252	463	3,217	12,646	不動産	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	1,089	1,769	1,671	6,569	不動産	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	531	1,068	2,531	9,947	食品・飲料・タバコ	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	333	617	2,977	11,699	素材	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	144	270	1,991	7,825	電気通信サービス	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	190	190	636	2,501	食品・生活必需品小売り	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	38	55	946	3,717	公益事業	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	744	1,669	2,420	9,510	小売	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	45	77	5,051	19,851	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	319	588	1,011	3,974	食品・飲料・タバコ	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	143	271	1,592	6,257	各種金融	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	54	147	3,219	12,651	ヘルスケア機器・サービス	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	906	2,295	1,893	7,440	運輸	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	208	449	4,254	16,719	公益事業	
BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	1,266	2,216	2,060	8,099	運輸	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	68	209	773	3,039	公益事業	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	408	781	4,061	15,960	公益事業	
OSOTSPA PCL-NVDR	162	385	1,078	4,236	食品・飲料・タバコ	

エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	180	433	671	2,637	各種金融	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	696	1,845	1,143	4,495	消費者サービス	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	208.91	367.91	1,563	6,145	小売	
SCG PACKAGING PCL-NVDR	172	273	1,521	5,981	素材	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	118	118	533	2,098	各種金融	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	130	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	76	162	599	2,355	各種金融	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	96	148	1,028	4,042	公益事業	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	54	54	510	2,005	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	16,238.91 42銘柄	31,801.91 43銘柄	117,376 —	461,291 <1.7%>	
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円		
DINO POLSKA SA	6.51	13.1	484	14,886	食品・生活必需品小売り	
MBANK SA	—	3.02	95	2,930	銀行	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	42.09	137.22	889	27,308	エネルギー	
LPP SA	0.15	0.23	217	6,664	耐久消費財・アパレル	
SANTANDER BANK POLSKA SA	5.65	7.51	201	6,190	銀行	
CD PROJEKT SA	10.44	14.69	193	5,931	メディア・娯楽	
PGE SA	100.7	195.08	124	3,822	公益事業	
CYFROWY POLSAT SA	33.8	57.42	107	3,294	メディア・娯楽	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	18.13	38.45	443	13,627	素材	
PKO BANK POLSKI SA	118.01	232.04	657	20,203	銀行	
BANK PEKAO SA	22.79	38.56	323	9,933	銀行	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	87.49	162.72	517	15,891	保険	
ORANGE POLSKA SA	67.1	157.37	108	3,345	電気通信サービス	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	212.26	—	—	—	エネルギー	
ALLEGRO. EU SA	48.4	106.74	246	7,572	小売	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	773.52 14銘柄	1,164.15 14銘柄	4,610 —	141,603 <0.5%>	
(ハンガリー)	百株	百株	千ハンガリー・フォリント	千円		
OTP BANK PLC	29.83	41.09	43,966	15,546	銀行	
RICHTER GEDEON NYRT	18.03	23.31	19,627	6,939	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	58.18	81.86	22,838	8,075	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	106.04 3銘柄	146.26 3銘柄	86,432 —	30,561 <0.1%>	
(ユーロ…ギリシャ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
JUMBO SA	14.51	28.51	42	6,127	小売	
MYTILINEOS S. A.	—	23.26	41	5,974	資本財	
FF GROUP	1.23	1.23	0	84	耐久消費財・アパレル	
ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	300	535.92	55	7,925	銀行	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	29.86	54.06	79	11,472	電気通信サービス	
NATIONAL BANK OF GREECE	—	133.89	50	7,228	銀行	



## エマージング株式インデックス・マザーファンド

銘柄		期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
PUBLIC POWER CORP		28.11	45.79	30	4,391	公益事業 銀行 消費者サービス
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A		350.17	640	68	9,896	
OPAP SA		27.76	47.84	62	9,039	
小計	株数・金額	751.64	1,510.5	432	62,141	
	銘柄数〈比率〉	7銘柄	9銘柄	—	< 0.2%〉	
ユーロ通貨計	株数・金額	751.64	1,510.5	432	62,141	
	銘柄数〈比率〉	7銘柄	9銘柄	—	< 0.2%〉	
合計	株数・金額	304,880.72	567,152.66	—	18,551,125	
	銘柄数〈比率〉	837銘柄	811銘柄	—	<69.9%〉	

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

※〈〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

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

### (2) 外国新株予約権証券

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

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

※〈〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(3) 外国投資信託証券

銘柄	口数	期首 (前期末)	口数	期 末		組入比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	口		口	千アメリカ・ドル	千円	%
ISHRS MSCI SAUDI ARABIA ETF	83,970		166,080	6,505	903,398	3.4
GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	729		—	—	—	—
ISHARES MSCI RUSSIA ETF	86,125		—	—	—	—
ISHARES MSCI UAE ETF	58,146		130,807	2,001	277,927	1.0
ISHARES MSCI QATAR ETF	38,065		82,108	1,672	232,265	0.9
ISHARES MSCI KUWAIT ETF	18,439		37,235	1,311	182,193	0.7
小 計	口数・金額	285,474	416,230	11,491	1,595,785	6.0
	銘柄数 <比率>	6銘柄	4銘柄		<6.0%>	
<b>(メキシコ)</b>	口		口	千メキシコ・ペソ	千円	
TRUST FIBRA UNO	36,300		66,400	1,594	11,514	0.0
CEMEX SAB-CPO	211,300		393,600	3,329	24,048	0.1
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	4,184		—	—	—	—
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	6,770		12,945	1,673	12,086	0.0
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	34,100		54,100	1,118	8,076	0.0
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	26,600		47,900	7,239	52,285	0.2
小 計	口数・金額	319,254	574,945	14,955	108,011	0.4
	銘柄数 <比率>	6銘柄	5銘柄		<0.4%>	
<b>(ブラジル)</b>	口		口	千ブラジル・レアル	千円	
ENERGISA SA-UNITS	1,800		4,800	207	5,440	0.0
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	16,000		29,100	729	19,158	0.1
BANCO INTER SA	4,200		—	—	—	—
GETNET ADQUIRENCIA E SERVICIO	1,575		—	—	—	—
KLABIN SA - UNIT	8,800		17,500	350	9,195	0.0
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	6,300		7,800	214	5,647	0.0
小 計	口数・金額	38,675	59,200	1,501	39,441	0.1
	銘柄数 <比率>	6銘柄	4銘柄		<0.1%>	
<b>(香港)</b>	口		口	千オフショア・人民元	千円	
CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	691,400		1,403,800	55,674	1,080,935	4.1
小 計	口数・金額	691,400	1,403,800	55,674	1,080,935	4.1
	銘柄数 <比率>	1銘柄	1銘柄		<4.1%>	
<b>(南アフリカ)</b>	口		口	千南アフリカ・ランド	千円	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	42,751		72,006	1,018	8,308	0.0
小 計	口数・金額	42,751	72,006	1,018	8,308	0.0
	銘柄数 <比率>	1銘柄	1銘柄		<0.0%>	
合 計	口数・金額	1,377,554	2,526,181	—	2,832,482	10.7
	銘柄数 <比率>	20銘柄	15銘柄		<10.7%>	

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

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

### (4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		期		末	
		買	建 額	売	建 額
外国	M S C I E m g M k t		百万円 5,271		百万円 —

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

### ■ 投資信託財産の構成

(2022年11月30日現在)

項 目	期		末	
	評 価	額	比	率
株 式		千円		%
株	18,551,125		69.6	
投資信託受益証券	1,080,935		4.1	
投資証券	1,751,546		6.6	
コール・ローン等、その他	5,277,043		19.8	
投資信託財産総額	26,660,650		100.0	

※期末における外貨建資産（26,353,695千円）の投資信託財産総額（26,660,650千円）に対する比率は98.8%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=138.87円、1香港・ドル=17.78円、1台湾・ドル=4.49円、1エジプト・ポンド=5.649円、1トルコ・リラ=7.449円、1メキシコ・ペソ=7.222円、1フィリピン・ペソ=2.453円、100チリ・ペソ=15.361円、100コロンビア・ペソ=2.885円、1インド・ルピー=1.71円、100インドネシア・ルピア=0.89円、1ブラジル・レアル=26.271円、1チェコ・コルナ=5.895円、100韓国・ウォン=10.48円、1オフショア・人民元=19.415円、1マレーシア・リンギット=30.789円、1南アフリカ・ランド=8.16円、1タイ・バーツ=3.93円、1ポーランド・ズロチ=30.711円、100ハンガリー・フォリント=35.359円、1ユーロ=143.58円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	26,839,754,030円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	4,114,829,618
株 式 (評価額)	18,551,125,070
投資信託受益証券 (評価額)	1,080,935,590
投 資 証 券 (評価額)	1,751,546,641
未 収 入 金	330,070,756
未 収 配 当 金	34,213,350
差 入 委 託 証 拠 金	977,033,005
(B) 負 債	289,143,609
未 払 金	262,300,000
未 払 解 約 金	26,843,066
そ の 他 未 払 費 用	543
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	26,550,610,421
元 本	16,108,126,428
次 期 繰 越 損 益 金	10,442,483,993
(D) 受 益 権 総 口 数	16,108,126,428口
1万口当たり基準価額 (C / D)	16,483円

※当期における期首元本額10,481,267,749円、期中追加設定元本額7,656,711,181円、期中一部解約元本額2,029,852,502円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	8,414,992,973円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,960,029,922円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	183,852,090円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	291,047,771円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	194,328,149円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	40,006,969円
三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型)	100,172,461円
三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型)	75,036,325円
三井住友・資産最適化ファンド (3 バランス型)	334,887,158円
三井住友・資産最適化ファンド (4 やや成長型)	274,169,234円
三井住友・資産最適化ファンド (5 成長重視型)	448,887,023円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	103,796,383円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,268,543円
日興FWS・新興国株インデックス (為替ヘッジあり)	706,099,778円
日興FWS・新興国株インデックス (為替ヘッジなし)	1,907,693,075円
三井住友DS・新興国株インデックス・ファンド13,672,741円	
SMAM・年金リスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	54,185,833円

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

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2021年12月1日 至2022年11月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	556,596,958円
受 取 配 当 金	547,919,936
受 取 利 息	4,844,360
そ の 他 収 益 金	4,323,205
支 払 利 息	△ 490,543
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 73,764,003
売 買 損 益	4,577,160,267
売 買 損 益	△ 4,650,924,270
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 829,599,240
取 引 損 益	292,520,767
取 引 損 益	△ 1,122,120,007
(D) そ の 他 費 用 等	△ 25,739,377
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	△ 372,505,662
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	7,067,369,472
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 1,362,991,688
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,110,611,871
(I) 合 計 (E + F + G + H)	10,442,483,993
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	10,442,483,993

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

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

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

# リート・インデックス・マザーファンド

第37期（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

信託期間	無期限（設定日：2005年6月21日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>日本の取引所に上場している不動産投資信託（リート）を主要投資対象とします。</li> <li>東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。</li> </ul>

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

## ■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) 東証REIT指数 (配当込み)		REIT指数 先物比率 (買建-売建)	投資信託 組入率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
33期（2021年8月25日）	27,121	6.3	4,601.21	6.3	0.6	98.9	7,535
34期（2022年2月25日）	24,907	△8.2	4,210.46	△8.5	0.5	98.3	8,187
35期（2022年8月25日）	27,322	9.7	4,623.32	9.8	0.4	99.1	9,741
36期（2023年2月27日）	25,673	△6.0	4,338.43	△6.2	0.3	98.3	11,580
37期（2023年8月25日）	26,570	3.5	4,486.82	3.4	0.3	98.9	13,212

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

## ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

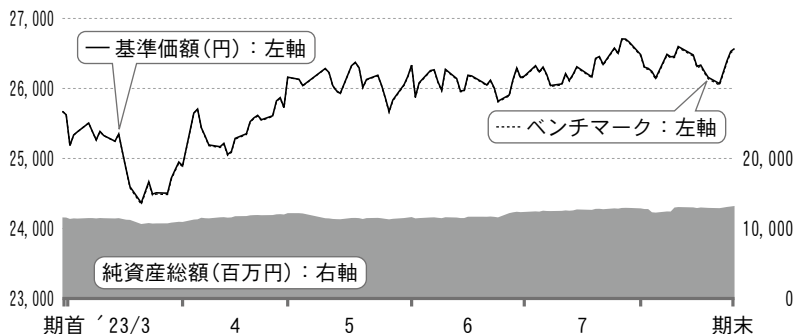
年月日	基準価額		(ベンチマーク) 東証REIT指数 (配当込み)		REIT指数 先物比率 (買建-売建)	投資信託 組入率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2023年2月27日	円	%		%	%	%
	25,673	—	4,338.43	—	0.3	98.3
2月末	25,625	△0.2	4,331.37	△0.2	0.3	98.3
3月末	24,895	△3.0	4,204.73	△3.1	0.3	98.2
4月末	26,161	1.9	4,420.34	1.9	0.3	98.8
5月末	26,333	2.6	4,448.91	2.5	0.3	98.9
6月末	26,175	2.0	4,421.28	1.9	0.3	98.9
7月末	26,483	3.2	4,472.88	3.1	0.3	98.7
(期末) 2023年8月25日	26,570	3.5	4,486.82	3.4	0.3	98.9

※騰落率は期首比です。

# 1 運用経過

## ▶ 基準価額等の推移について（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

### 基準価額等の推移



期首	25,673円
期末	26,570円
騰落率	+3.5%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。

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

## ▶ 基準価額の主な変動要因（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

当ファンドは、主として日本の取引所に上場している不動産投資信託（リート）に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

上昇要因	・日銀による金融緩和政策が継続されたこと
下落要因	・米国の銀行破綻や欧州大手金融機関の経営不安の報道が重なり、金融不安が広がったこと

---

▶ 投資環境について（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

---

Ｊリート市場は、上昇しました。

期初は、米国の銀行破綻に欧州大手金融機関の経営不安の報道が重なったことで金融不安が広がり、リスク回避の動きが強まり急落しました。

3月下旬から期末にかけて、日銀新総裁が就任記者会見で現行の金融緩和政策を継続する意向を示したことや各国金融当局が不安解消に向けて対応策を迅速に打ち出したことで上昇しました。

---

▶ ポートフォリオについて（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

---

**リート組入比率**

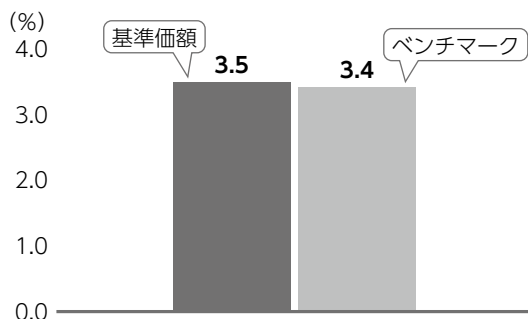
東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、リーートの組入比率は高位を保ちました。

**ポートフォリオの特性**

主として日本の取引所に上場しているリートに投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。また、東証REIT指数先物を利用することで、実質組入比率を高位に維持しました。

▶ ベンチマークとの差異について（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドは、東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとしています。

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+3.5%となり、ベンチマークの騰落率+3.4%を0.1%上方乖離しました。

上方乖離要因 ・ 現金などのキャッシュポジションが相場下落時にプラス寄与したこと

## 2 今後の運用方針

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



# Jリート・インデックス・マザーファンド

## ■ 1万口当たりの費用明細 (2023年2月28日から2023年8月25日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション) (投資信託証券)	5円 (0) (5)	0.019% (0.000) (0.018)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	5	0.019	

期中の平均基準価額は25,876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2月28日から2023年8月25日まで)

### (1) 投資信託証券

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	エスコンジャパンリート投資法人	61	千円 7,035	33	千円 3,675
	サンケイリアルエステート投資法人	93	8,280	47	4,040
	S O S I L A 物流リート投資法人	143	18,821	83	11,030
	東海道リート投資法人	45	5,403	43	5,079
	日本アコモデーションファンド投資法人	99	63,292	57	36,109
	森ヒルズリート投資法人	342	50,659	197	29,131
	産業ファンド投資法人	456	67,416	230	34,595
	産業ファンド新	△ 8 ( 8)	— ( 1,106)	— ( —)	— ( —)
	アドバンス・レジデンス投資法人	286	96,833	222	75,172
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	214	46,258	123	25,890
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	149	59,862	88	34,469
	GLP投資法人	1,136	153,450	550	80,971
	GLP投資法人 新	△ 69 ( 69)	— ( 10,014)	— ( —)	— ( —)
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	156	50,872	80	26,277
	コンフォリア・レジ 新	△ 4 ( 4)	— ( 1,296)	— ( —)	— ( —)
日本プロロジスリート投資法人	558	158,528	278	82,181	
日本プロロジスリート新	△ 19 ( 19)	— ( 5,512)	— ( —)	— ( —)	

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	星野リゾート・リート投資法人	66	42,977	33	22,277
	Oneリート投資法人	47	11,433	26	6,263
	イオンリート投資法人	437	66,051	196	29,386
	ヒューリックリート投資法人	273	43,024	156	24,289
	日本リート投資法人	92	30,708	52	16,672
	積水ハウス・リート投資法人	878	70,137	505	38,754
	トーセイ・リート投資法人	59	7,839	44	5,776
	ケネディクス商業リート投資法人	127	33,744	73	18,328
	ヘルスケア&メディカル投資法人	71	11,357	39	6,223
	サムティ・レジデンシャル投資法人	72	8,490	—	—
	野村不動産マスターファンド投資法人	947	152,803	543	86,064
	いちごホテルリート投資法人	42	4,401	20	2,142
	ラサールロジポート投資法人	427	62,000	208	32,547
	ラサールロジポート投資 新	△ 29 ( 29)	— ( 4,337)	— ( —)	— ( —)
	スターアジア不動産投資法人	706	29,725	210	11,641
	スターアジア不動産投 新	△ 174 ( 174)	— ( 9,262)	— ( —)	— ( —)
	マリモ地方創生リート投資法人	46	5,922	25	3,166
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	123	54,420	48	23,613
	三井不ロジパーク 新	△ 13 ( 13)	— ( 6,210)	— ( —)	— ( —)
	大江戸温泉リート投資法人	40	2,578	24	1,553
	投資法人みらい	429	19,702	206	9,285
	森トラスト・ホテルリート投資法人	(△ 255)	( —)	( —)	( —)
	三菱地所物流リート投資法人	103	41,758	57	23,178
	CREロジスティクスファンド投資法人	172	26,850	69	12,446
	CREロジスティクスファン新	△ 22 ( 22)	— ( 3,622)	— ( —)	— ( —)
	ザイマックス・リート投資法人	46	5,217	25	2,777
	タカラレーベン不動産投資法人	183	15,616	79	7,241
	タカラレーベン不動産投 新	△ 16	—	—	—
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	132	17,707	73	9,831
	日本ビルファンド投資法人	339	195,252	195	111,047
	ジャパンリアルエステイト投資法人	329	171,328	171	93,808
	ジャパンリアルエステイト 新	△ 17 ( 17)	— ( 9,079)	— ( —)	— ( —)
日本都市ファンド投資法人	1,435	139,342	1,113	108,227	

## Jリート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	オリックス不動産投資法人	583	103,224	334	58,550
	日本プライムリアルティ投資法人	199	70,291	114	39,852
	N T T都市開発リート投資法人	279	37,208	161	21,255
	東急リアル・エステート投資法人	195	36,235	111	20,333
	グローバル・ワン不動産投資法人	218	24,119	123	13,322
	ユナイテッド・アーバン投資法人	654	96,969	375	55,146
	森トラストリート投資法人	632 ( 469)	45,333 ( -)	316 ( -)	22,361 ( -)
	インヴィンシブル投資法人	1,843	88,817	757	42,735
	インヴィンシブル投資法人 新	△ 267 ( 267)	- ( 14,836)	- ( -)	- ( -)
	フロンティア不動産投資法人	108	51,546	61	29,034
	平和不動産リート投資法人	278	39,946	117	17,931
	平和不動産リート 新	△ 9 ( 9)	- ( 1,334)	- ( -)	- ( -)
	日本ロジスティクスファンド投資法人	190	58,406	148	45,073
	福岡リート投資法人	151	24,687	87	14,085
	ケネディクス・オフィス投資法人	171	55,374	99	30,849
	いちごオフィスリート投資法人	236	21,631	138	12,109
	大和証券オフィス投資法人	48	29,356	24	14,659
	阪急阪神リート投資法人	163	23,361	77	10,961
	スターツプロシード投資法人	47	10,651	27	6,099
	大和ハウスリート投資法人	441	123,477	253	71,320
ジャパン・ホテル・リート投資法人	942	69,485	541	40,330	
大和証券リビング投資法人	317	35,612	134	15,242	
ジャパンエクセレント投資法人	259	32,164	207	25,696	

※金額は受渡し代金。

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

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

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

## Jリート・インデックス・マザーファンド

### (2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国内 R E I T 指 数 先 物 取 引	百万円 73	百万円 73	百万円 —	百万円 —

※金額は受渡し代金。

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2023年2月28日から2023年8月25日まで)

#### (1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$

#### (2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
投 資 信 託 証 券	百万円 66

#### (3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	2,213千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	45千円
(c) (b) / (a)	2.1%

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

### ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年2月28日から2023年8月25日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2023年8月25日現在)

(1) 国内投資信託証券

銘柄	柄	期首 (前期末)		期		末	
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率
		口		口		千円	%
エスコンジャパンリート投資法人			219		247	28,429	0.2
サンケイリアルエステート投資法人			346		392	36,769	0.3
S O S I L A 物流リート投資法人			551		611	77,841	0.6
東海道リート投資法人			178		180	21,690	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人			380		422	282,740	2.1
森ヒルズリート投資法人		1,295		1,440		209,088	1.6
産業ファンド投資法人		1,645		1,871		268,488	2.0
アドバンス・レジデンス投資法人		1,100		1,164		413,802	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人			808		899	201,645	1.5
アクティビア・プロパティーズ投資法人			581		642	259,368	2.0
GLP投資法人		3,551		4,137		577,938	4.4
コンフォリア・レジデンシャル投資法人			526		602	204,379	1.5
日本プロロジスリート投資法人			1,854		2,134	614,592	4.7
星野リゾート・リート投資法人			192		225	144,000	1.1
Oneリート投資法人			190		211	54,184	0.4
イオンリート投資法人			1,261		1,502	220,493	1.7
ヒューリックリート投資法人			1,030		1,147	189,713	1.4
日本リート投資法人			357		397	138,354	1.0
積水ハウス・リート投資法人			3,309		3,682	308,183	2.3
トーセイ・リート投資法人			241		256	35,174	0.3
ケネディクス商業リート投資法人			479		533	152,544	1.2
ヘルスケア&メディカル投資法人			268		300	44,220	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人			254		326	37,098	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人			3,557		3,961	679,707	5.1
いちごホテルリート投資法人			178		200	23,120	0.2
ラサールロジポート投資法人			1,348		1,567	235,520	1.8
スターアジア不動産投資法人			1,381		1,877	103,985	0.8
マリモ地方創生リート投資法人			165		186	23,380	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人			434		509	247,883	1.9
大江戸温泉リート投資法人			170		186	12,052	0.1
投資法人みらい			1,345		1,568	73,774	0.6
森トラスト・ホテルリート投資法人			255		—	—	—
三菱地所物流リート投資法人			377		423	168,354	1.3
CREロジスティクスファンド投資法人			424		527	88,536	0.7
ザイマックス・リート投資法人			174		195	23,068	0.2
タカラレーベン不動産投資法人			477		581	56,357	0.4
タカラレーベン不動産投 新			16		—	—	—
アドバンス・ロジスティクス投資法人			479		538	69,886	0.5
日本ビルファンド投資法人			1,283		1,427	847,638	6.4
ジャパンリアルエステイト投資法人			1,100		1,258	740,962	5.6
日本都市ファンド投資法人			5,550		5,872	580,740	4.4
オリックス不動産投資法人			2,192		2,441	445,238	3.4
日本プライムリアルティ投資法人			753		838	304,613	2.3

## Jリート・インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首 (前期末)		期		末	
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率
NTT都市開発リート投資法人			1,059		1,177	160,307	1.2
東急リアル・エステート投資法人			738		822	151,083	1.1
グローバル・ワン不動産投資法人			810		905	104,618	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人			2,462		2,741	426,499	3.2
森トラストリート投資法人			1,578		2,363	175,098	1.3
インヴィンシブル投資法人			4,847		5,933	349,453	2.6
フロンティア不動産投資法人			407		454	213,607	1.6
平和不動産リート投資法人			754		915	130,753	1.0
日本ロジスティクスファンド投資法人			742		784	236,768	1.8
福岡リート投資法人			569		633	104,445	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人			641		713	243,489	1.8
いちごオフィスリート投資法人			906		1,004	89,155	0.7
大和証券オフィス投資法人			226		250	167,750	1.3
阪急阪神リート投資法人			498		584	82,168	0.6
スターツプロシード投資法人			190		210	44,877	0.3
大和ハウスリート投資法人			1,658		1,846	520,018	3.9
ジャパン・ホテル・リート投資法人			3,550		3,951	295,534	2.2
大和証券リビング投資法人			1,491		1,674	185,311	1.4
ジャパンエクセレント投資法人			1,012		1,064	140,022	1.1
合 計	口 数	金 額	66,411		75,497	13,066,520	98.9
	銘 柄 数	<比 率>	62銘柄		60銘柄	<98.9%>	

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※外国籍の投資信託証券を含む場合があります。

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

※期末時点の保有銘柄のうち、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、ラサールロジポート投資法人、いちごホテルリート投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、星野リゾート・リート投資法人、日本プロロジスリート投資法人、GLP投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、インヴィンシブル投資法人、大和証券リビング投資法人、大和ハウスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、福岡リート投資法人、フロンティア不動産投資法人、日本ビルファンド投資法人につきましては、委託会社の利害関係人等である株式会社三井住友銀行が一般事務受託会社になっています。(当該投資法人で開示されている直近の有価証券報告書等より記載)

### (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	期		末	
			買	建 額	売	建 額
国 内	東 証	R E I T		百万円 37		百万円 -

## ■ 投資信託財産の構成

(2023年8月25日現在)

項 目	期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
投 資 証 券	13,066,520	98.5	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	200,709	1.5		
投 資 信 託 財 産 総 額	13,267,229	100.0		

## Jリート・インデックス・マザーファンド

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年8月25日現在)

項 目	期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>13,266,627,802円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	109,181,111
投 資 証 券 (評 価 額)	13,066,520,300
未 収 入 金	657,600
未 収 配 当 金	88,640,791
差 入 委 託 証 拠 金	1,628,000
<b>(B) 負 債</b>	<b>54,595,815</b>
未 払 金	48,411,185
未 払 解 約 金	6,183,411
そ の 他 未 払 費 用	1,219
<b>(C) 純 資 産 総 額 (A - B)</b>	<b>13,212,031,987</b>
元 本	4,972,524,941
次 期 繰 越 損 益 金	8,239,507,046
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>4,972,524,941口</b>
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	26,570円

※当期における期首元本額4,510,940,680円、期中追加設定元本額1,345,229,018円、期中一部解約元本額883,644,757円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	235,220,778円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	316,152,868円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	143,447,577円
イオン・バランス戦略ファンド	22,065,138円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,514,179,571円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,880,906円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	39,063,929円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,725,679円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	160,007,336円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	98,903,746円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	74,867,373円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	39,819,080円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,428,986円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	226,335,244円
日興FWS・Jリートインデックス	582,952,185円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	61,946,381円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	10,354円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	12,774円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	19,339円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	26,282円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	26,282円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	122,781円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,062,001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)	6,891,186円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	4,242,932円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	2,869,176円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,187,886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>	82,496,728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>	52,981,662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>	84,581,941円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド2021-05(リスク3%)<適格機関投資家限定>	158,996,840円

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

### ■ 損益の状況

(自2023年2月28日 至2023年8月25日)

項 目	当 期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>166,504,623円</b>
受 取 配 当 金	166,516,885
受 取 利 息	337
そ の 他 収 益 金	17,136
支 払 利 息	△ 29,735
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>243,060,396</b>
売 買 益	438,376,434
売 買 損	△ 195,316,038
<b>(C) 先 物 取 引 等 損 益</b>	<b>1,196,400</b>
取 引 益	1,510,800
取 引 損	△ 314,400
<b>(D) そ の 他 費 用 等</b>	<b>△ 2,482</b>
<b>(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)</b>	<b>410,758,937</b>
<b>(F) 前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>7,069,820,345</b>
<b>(G) 解 約 差 損 益 金</b>	<b>△ 1,387,219,750</b>
<b>(H) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>2,146,147,514</b>
<b>(I) 合 計 (E + F + G + H)</b>	<b>8,239,507,046</b>
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	8,239,507,046

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

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

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

### ■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

# 外国リート・インデックス・マザーファンド

第37期（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

信託期間	無期限（設定日：2005年6月21日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>■日本を除く世界各国の不動産投資信託（リート）などを主要投資対象とします。</li> <li>■S &amp; P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。</li> <li>■外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。</li> </ul>

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

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、 円換算ベース)		投証比 資産信託 比率	純資産 総額
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
33期（2021年8月25日）	26,128	19.9%	293.88	20.5%	99.3%	15,061
34期（2022年2月25日）	27,214	4.2%	305.61	4.0%	99.1%	18,859
35期（2022年8月25日）	30,120	10.7%	339.05	10.9%	98.8%	24,967
36期（2023年2月27日）	28,341	△5.9%	319.70	△5.7%	99.0%	26,782
37期（2023年8月25日）	29,306	3.4%	331.50	3.7%	96.7%	29,336

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

※S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）の所有権およびその他一切の権利は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスが有しています。三井住友DSアセットマネジメントは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスとの間で同指数の算出・管理に関する契約を締結しています。S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、同指数の算出に関し、いかなるものに対しても責任を負うものではありません。

## ■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、 円換算ベース)		投証比 資産信託 比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2023年2月27日	28,341	—	319.70	—	99.0%
2月末	28,396	0.2%	320.31	0.2%	99.1%
3月末	26,449	△6.7%	298.25	△6.7%	98.7%
4月末	27,061	△4.5%	305.23	△4.5%	98.3%
5月末	27,472	△3.1%	310.02	△3.0%	99.1%
6月末	29,462	4.0%	333.07	4.2%	98.7%
7月末	29,617	4.5%	334.97	4.8%	97.6%
(期末) 2023年8月25日	29,306	3.4%	331.50	3.7%	96.7%

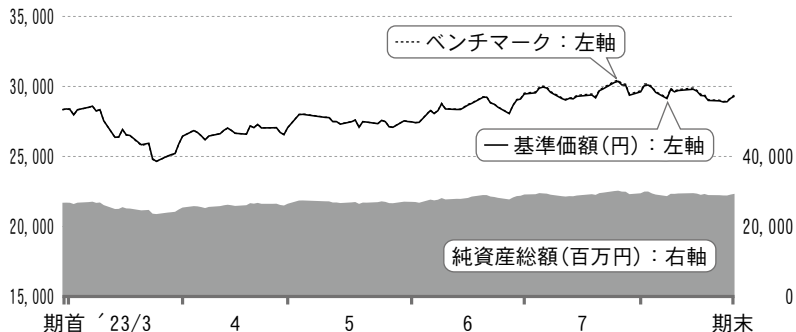
※騰落率は期首比です。



# 1 運用経過

## ▶ 基準価額等の推移について（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

### 基準価額等の推移



期首	28,341円
期末	29,306円
騰落率	+3.4%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）です。

※S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）の所有権およびその他一切の権利は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスが有しています。三井住友DSアセットマネジメントは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスとの間で同指数の算出・管理に関する契約を締結しています。S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、同指数の算出に関し、いかなるものに対しても責任を負うものではありません。

## ▶ 基準価額の主な変動要因（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

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

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> <li>・インフレ率の上昇鈍化を受けて、欧米の中央銀行の利上げペースが鈍化すると観測が高まったこと</li> <li>・米国でインフレ率が鈍化傾向にあることや、日本と欧米との金融政策の違いから金利差が意識され対主要通貨で円安となったこと</li> </ul>
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> <li>・米国地方銀行の破綻をきっかけに欧米金融機関の財務懸念が高まったこと</li> <li>・欧米を中心に、利上げ観測が継続すると見方が広まり長期金利（10年国債利回り）が上昇したこと</li> </ul>

### ▶ 投資環境について（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

グローバル・リート市場は、一進一退となりました。為替市場は米ドル、ユーロなどが対円で上昇しました。

#### グローバル・リート市場

3月下旬にかけては、F R B（米連邦準備制度理事会）のパウエル議長が利上げペースの加速を示唆したことや、欧米金融機関の財務懸念が嫌気されたことなどから下落基調となりました。

4月以降は、金融不安が和らいだことに加えて、米国で住宅需要への楽観的な見通しが広まったことや、米インフレ率が鈍化傾向にあることなどを背景に上昇しました。

期末にかけては、大手格付け会社による米国債格付け引き下げや、F R B 議長のタカ派（インフレ抑制を重視する立場）姿勢を受けて金利が上昇し、リートは下落に転じました。

#### 為替市場

米ドル・円は、日銀が現行の大規模金融緩和策を維持する一方で、米国では追加利上げが示唆されるなど、金融政策の違いから金利差の拡大が意識され、対米ドルでの円安が進みました。

ユーロ・円も、金融の引き締め政策を実施する E C B（欧州中央銀行）との金融政策の違いから円売り圧力が強まり、ユーロ・円は上昇しました。

### ▶ ポートフォリオについて（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

#### ポートフォリオの特性

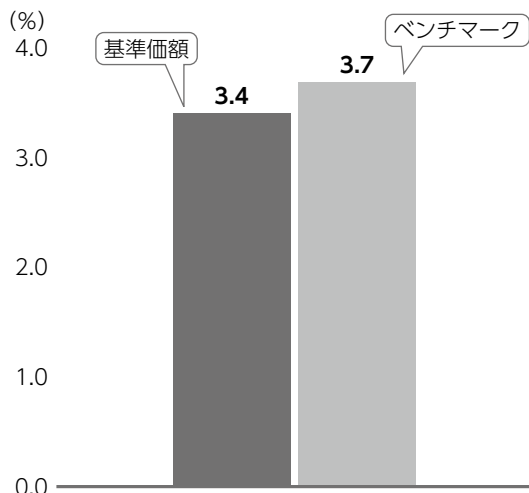
S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

日々の追加設定・解約による資金移動に応じてリーートの売買を行い、トラッキングエラー（ポートフォリオのリターンとベンチマークのリターンとの乖離）の抑制に努めました。

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

▶ ベンチマークとの差異について（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドは、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）をベンチマークとしています。

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+3.4%となり、ベンチマークの騰落率+3.7%を0.3%下回りました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストや現地証券保管銀行の証券保管コストが生じたこと

## 2 今後の運用方針

引き続き、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

個別銘柄においてもベンチマーク時価ウェイトに沿った投資を行い、トラッキングエラーを抑制します。また、リート組入比率を高位に保つことを基本とします。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

### ■ 1万口当たりの費用明細 (2023年2月28日から2023年8月25日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売買委託手数料 (投資信託証券)	3円 (3)	0.011% (0.011)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (投資信託証券)	1 (1)	0.002 (0.002)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	7 (6) (1)	0.025 (0.021) (0.004)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送回数・資産の移転等に要する費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	11	0.038	

期中の平均基準価額は28,077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2月28日から2023年8月25日まで)

#### 投資信託証券

		買 付		売 付		
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外	アメリ カ	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	4,915	64	2,130	28
		AGREE REALTY CORP	1,531	100	—	—
		EASTGROUP PROPERTIES INC	445	77	29	5
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,461	253	—	—
		SIMON PROPERTY GROUP INC	2,194	232	—	—
		BOSTON PROPERTIES INC	1,344	69	—	—
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	3,788	71	—	—
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	1,438	56	—	—
		URBAN EDGE PROPERTIES	5,374	76	—	—
		PARAMOUNT GROUP INC	14,422	65	11,000	48
		EQUITY RESIDENTIAL	2,870	170	—	—
		EQUINIX INC	983	715	242	185
		SUN COMMUNITIES INC	992	133	446	59
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	2,053	100	—	—
		HOST HOTELS & RESORTS INC	2,652	45	—	—
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	2,738	88	—	—
		REALTY INCOME CORP	13,474	825	2,401	143
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	5,660	75	—	—
		国		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,838	272
TERRENO REALTY CORP	500			31	—	—
NNN REIT INC	1,910			81	—	—
INVITATION HOMES INC	5,547			173	—	—
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	2,500	31	—	—

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	2,280	61	—	—
	VICI PROPERTIES INC	16,166	517	2,414	76
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	6,303	349	1,712	91
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,492	135	195	19
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	2,709	66	1,619	39
	KIMCO REALTY CORP	3,281	61	—	—
	STAG INDUSTRIAL INC	1,000	32	—	—
	CARETRUST REIT INC	2,992	59	—	—
	BROADSTONE NET LEASE INC	8,090	133	—	—
	INDUS REALTY TRUST INC	(△ 823)	(△ 54)	( —)	( —)
	ORION OFFICE REIT INC	9,895	66	7,000	47
	INVENTRUST PROPERTIES CORP	3,460	78	—	—
	SAFEHOLD INC	(△ 8,226)	( —)	( —)	( —)
	LIFE STORAGE INC	572 (△ 13,356)	82 ( —)	( —)	( —)
	STAR HOLDINGS	( 2,111)	( —)	( —)	( —)
	VENTAS INC	2,128	94	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	1,885	102	—	—
	PROLOGIS INC	8,053	981	1,822	226
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,089	257	—	—
	BRANDYWINE REALTY TRUST	14,416	62	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,757	185	1,336	145
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	486	102	260	59
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	897	80	826	75
	WELLTOWER INC	7,982	619	1,086	85
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5,862	121	—	—
	LTC PROPERTIES INC	2,215	74	—	—
	MACERICH CO/THE	7,058	80	4,508	50
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,035	66	—	—
	PUBLIC STORAGE	1,252	363	186	53
	REGENCY CENTERS CORP	1,316 ( 2,154)	79 ( —)	( —)	( —)
	UDR INC	2,091	84	—	—
	CUBESMART	1,693	79	—	—
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	3,000	28	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	2,759	263	—	—	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,677 ( 11,953)	254 ( —)	719 ( —)	106 ( —)	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	19,642	167	9,852	81	
DOUGLAS EMMETT INC	2,814	33	—	—	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	4,055	55	—	—	
EQUITY COMMONWEALTH	2,840	57	—	—	
FARMLAND PARTNERS INC	—	—	2,130	26	

国

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付		
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外	GLOBAL NET LEASE INC	5,967	70	—	—	
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,493	72	—	—	
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	500	35	—	—	
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1,390	55	—	—	
	SAFEHOLD INC/OLD	(△ 3,366)	( — )	( — )	( — )	
	UMH PROPERTIES INC	5,032	82	—	—	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	(△ 6,208)	( — )	( — )	( — )	
	WP CAREY INC	3,040	224	—	—	
	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	( — )	(△ 0)	( — )	( — )	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	( — )	(△ 1)	( — )	( — )	
	PRIME US REIT	( — )	(△ 0)	( — )	( — )	
	カ ナ ダ	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	□	千カナダ・ドル	□	千カナダ・ドル
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T		—	—	1,307	19	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T		—	—	6,781	21	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T		545	9	—	—	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E		1,298	15	—	—	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		5,575	78	—	—	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		812	67	—	—	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4,576	56	—	—		
オーストラリア	SCENTRE GROUP	□	千オーストラリア・ドル	□	千オーストラリア・ドル	
	SCENTRE GROUP	25,839	72	—	—	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	60,000	34	—	—	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	31,922	98	10,000	27	
	NATIONAL STORAGE REIT	46,817	118	—	—	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	34,536	104	—	—	
	GDI PROPERTY GROUP	40,000	27	—	—	
	CENTURIA OFFICE REIT	25,000	35	—	—	
	DEXUS/AU	4,000	31	—	—	
	ABACUS STORAGE KING	( 50,980)	( — )	( — )	( — )	
	GPT GROUP	19,971	87	—	—	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	29,237	112	—	—	
国	MIRVAC GROUP	50,365	111	—	—	
	STOCKLAND	55,915	239	48,556	205	
	GOODMAN GROUP	17,351	340	3,914	76	
	香 港	CHAMPION REIT	□	千香港・ドル	□	千香港・ドル
		LINK REIT	—	—	96,000	272
		LINK REIT -RIGHTS	26,300	1,287	—	—
		FORTUNE REIT	—	—	75,480	—
	FORTUNE REIT	51,000	341	—	—	

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付		
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外	シンガポール	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	□ 千シンガポール・ドル ( - )	- (△ 1)	□ 千シンガポール・ドル ( - )	- ( - )
		PARAGON REIT	99,500	93	-	-
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	( 51,300 )	(△ 121 0)	( - )	( - )
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	( - )	(△ 1)	( - )	( - )
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	25,000	57	-	-
		KEPPEL DC REIT	( - )	(△ 2)	( - )	( - )
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	( - )	(△ 2)	( - )	( - )
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	( 21,100 )	(△ 60 6)	( - )	( - )
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	( - )	(△ 1)	( - )	( - )
		SUNTEC REIT	( - )	(△ 1)	( - )	( - )
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	( - )	(△ 10)	( - )	( - )
		KEPPEL REIT	( - )	(△ 0)	( - )	( - )
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	( 58,700 )	(△ 61 3)	( - )	( - )
		ESR-LOGOS REIT	( 310,900 )	(△ 101 1)	( 78,400 )	( 26 )
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	( - )	(△ 0)	( - )	( - )
		CAPITALAND CHINA TRUST	( - )	(△ 6)	( - )	( - )
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE TRUST	( - )	(△ 0)	( - )	( - )
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	( - )	(△ 1)	( - )	( - )
		STARHILL GLOBAL REIT	185,000	95	128,200	65
		AIMS APAC REIT	( - )	(△ 1)	( - )	( - )
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	( - )	(△ 0)	( - )	( - )
国	ニュージーランド	GOODMAN PROPERTY TRUST	□ 千ニュージーランド・ドル 8,876	19	□ 千ニュージーランド・ドル -	-
		PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	24,708	31	-	-
イギリス	イギリス	TRITAX BIG BOX REIT PLC	□ 千イギリス・ポンド 29,959	39	□ 千イギリス・ポンド -	-
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	28,929	54	-	-
		EDISTON PROPERTY INVESTMENT	48,662	33	-	-
		HELICAL PLC	17,000	45	-	-
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	( 35,545 ) ( 144,308 )	( 42 ) ( - )	( - )	( - )

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付			
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額		
外		SEGR0 PLC	10,481	81	—	—	
		BRITISH LAND CO PLC	15,157	55	—	—	
		DERWENT LONDON PLC	2,220	48	1,757	39	
		SHAFTESBURY PLC	(△ 43,000)	( — )	( — )	( — )	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	—	—	108,964	86	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	30,067	32	—	—	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	46,835	46	—	—	
	イスラエル	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	□	千イスラエル・シュケル	□	千イスラエル・シュケル	
		REIT 1 LTD	5,230	43	—	—	
	韓 国		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	□	千韓国・ウォン	□	千韓国・ウォン
			D&D PLATFORM REIT CO LTD	( — )	(△ 0)	( — )	( — )
			SK REITS CO LTD	( — )	(△ 6)	( — )	( — )
			NH ALL-ONE REIT CO LTD	( — )	(△ 484)	( — )	( — )
			SHINHAN ALPHA REIT CO-RIGHTS	( — )	(△ 654)	( — )	( — )
IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS			( 1,606)	( — )	( 1,606)	( — )	
SK REITS CO LTD-RIGHTS			( — )	( — )	( — )	( — )	
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1			( 1,626)	( — )	( 1,626)	( — )	
国	オランダ	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	( 4,803)	( — )	( — )	( — )	
		VASTNED RETAIL NV	7,912	33,936	—	—	
	ベルギー		RETAIL ESTATES	□	千ユーロ	□	千ユーロ
			AEDIFICA	884	18	—	—
			AEDIFICA SA-RIGHTS	479	31	—	—
			COFINIMMO	1,568	99	—	—
			WAREHOUSES DE PAUW SCA	( — )	( — )	6,249	2
			CARE PROPERTY INVEST	( 6,249)	( — )	( — )	( — )
			XIOR STUDENT HOUSING NV	227	17	—	—
	フランス		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	744	19	—	—
			ICADE	—	—	1,894	23
			GECINA SA	1,149	34	—	—
			KLEPIERRE	472	23	—	—
			COVIVIO	( — )	(△ 8)	( — )	( — )
ALTAREA			472	45	—	—	
ポ		CARMILA	3,173	67	2,317	50	
		ALTAREA	( — )	(△ 0)	( — )	( — )	
		CARMILA	( 3,036)	(△ 10)	( — )	( — )	



## 外国リート・インデックス・マザーファンド

			買 付		売 付	
			口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国	ス ペ イ ン	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	3,106	24	—	—
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	( — )	(△ 2)	( — )	( — )
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	( — )	(△ 3)	( — )	( — )
	そ の 他	CROMWELL REIT EUR	( — )	(△ 3)	( — )	( — )

※金額は受渡し代金。

※（ ）内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2023年2月28日から2023年8月25日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

### ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年2月28日から2023年8月25日まで)

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

外国リート・インデックス・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2023年8月25日現在)

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		期		末
	口数	口数	評価額		組入比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)	口	口	千アメリカ・ドル	千円	%
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000	69,000	37	5,549	0.0
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900	130,900	34	5,072	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000	20,000	2	400	0.0
PRIME US REIT	130,700	130,700	18	2,713	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900	245,900	18	2,660	0.0
(アメリカ)					
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	17,544	20,329	285	41,674	0.1
LXP INDUSTRIAL TRUST	43,773	43,773	422	61,764	0.2
RPT REALTY	11,788	11,788	113	16,546	0.1
AGREE REALTY CORP	13,650	15,181	940	137,447	0.5
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,741	7,157	1,271	185,931	0.6
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,869	22,330	4,038	590,524	2.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	49,073	51,267	5,673	829,536	2.8
BOSTON PROPERTIES INC	21,368	22,712	1,470	215,064	0.7
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,200	23,200	182	26,629	0.1
VORNADO REALTY TRUST	24,385	24,385	538	78,692	0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	55,645	59,433	999	146,083	0.5
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	45,489	45,489	970	141,940	0.5
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	20,717	22,155	850	124,396	0.4
URBAN EDGE PROPERTIES	15,028	20,402	314	45,940	0.2
PARAMOUNT GROUP INC	20,155	23,577	115	16,892	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	50,255	53,125	3,405	497,924	1.7
EPR PROPERTIES	11,259	11,259	494	72,288	0.2
EQUINIX INC	13,830	14,571	11,149	1,630,228	5.6
SUN COMMUNITIES INC	18,735	19,281	2,405	351,703	1.2
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	38,327	40,380	1,850	270,537	0.9
HOST HOTELS & RESORTS INC	108,783	111,435	1,742	254,838	0.9
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	45,788	48,526	1,715	250,824	0.9
REALTY INCOME CORP	94,000	105,073	5,921	865,902	3.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289	17,289	107	15,698	0.1
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16,432	22,092	292	42,833	0.1
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,051	6,051	304	44,468	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,091	18,198	2,605	380,962	1.3

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末
	口数	口数	評価額		組入比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
TERRENO REALTY CORP	10,836	11,336	674	98,624	0.3
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,679	32,679	396	57,961	0.2
NNN REIT INC	26,145	28,055	1,106	161,831	0.6
INVITATION HOMES INC	85,980	91,527	3,075	449,671	1.5
XENIA HOTELS & RESORTS INC	15,327	17,827	199	29,168	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	36,597	36,597	495	72,508	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,722	35,722	451	66,074	0.2
APPLE HOSPITALITY REIT INC	32,409	32,409	471	68,950	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	14,792	14,792	216	31,643	0.1
RLJ LODGING TRUST	24,132	24,132	231	33,874	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,500	13,780	341	49,909	0.2
VICI PROPERTIES INC	143,668	157,420	4,776	698,364	2.4
COUSINS PROPERTIES INC	22,991	22,991	520	76,042	0.3
AMERICOLD REALTY TRUST INC	41,510	41,510	1,357	198,536	0.7
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	26,773	31,364	1,641	240,033	0.8
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,817	9,114	759	111,036	0.4
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	21,200	22,290	524	76,657	0.3
KIMCO REALTY CORP	93,700	96,981	1,815	265,460	0.9
APARTMENT INCOME REIT CO	23,374	23,374	778	113,845	0.4
GETTY REALTY CORP	6,971	6,971	209	30,701	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	20,455	20,455	1,049	153,494	0.5
STAG INDUSTRIAL INC	26,802	27,802	1,001	146,428	0.5
CARETRUST REIT INC	13,303	16,295	321	47,033	0.2
BROADSTONE NET LEASE INC	23,684	31,774	503	73,639	0.3
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165	2,165	37	5,413	0.0
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515	2,515	6	956	0.0
INDUS REALTY TRUST INC	823	—	—	—	—
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424	1,424	20	2,992	0.0
ORION OFFICE REIT INC	5,199	8,094	46	6,757	0.0
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	17,364	17,364	590	86,299	0.3
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,406	11,866	273	40,044	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648	3,648	78	11,537	0.0
SAFEHOLD INC	13,800	5,574	114	16,757	0.1
BLUEROCK HOMES TRUST INC	468	468	6	912	0.0
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	7,478	7,478	73	10,748	0.0
LIFE STORAGE INC	12,784	—	—	—	—
STAR HOLDINGS	—	2,111	28	4,176	0.0

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末
	口数	口数	評価額		組入比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
VENTAS INC	60,416	62,544	2,708	395,986	1.3
IRON MOUNTAIN INC	43,700	45,585	2,759	403,525	1.4
PROLOGIS INC	138,017	144,248	17,560	2,567,733	8.8
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,510	24,599	2,857	417,811	1.4
BRANDYWINE REALTY TRUST	20,191	34,607	164	23,985	0.1
VERIS RESIDENTIAL INC	10,798	10,798	196	28,751	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	15,876	16,297	1,737	254,069	0.9
SITE CENTERS CORP	26,013	26,013	334	48,914	0.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,829	10,055	2,388	349,285	1.2
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,020	11,091	1,082	158,296	0.5
WELLTOWER INC	70,907	77,803	6,252	914,203	3.1
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	79,876	85,738	1,733	253,490	0.9
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,359	16,359	375	54,848	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,446	25,446	209	30,621	0.1
KILROY REALTY CORP	16,719	16,719	589	86,173	0.3
LTC PROPERTIES INC	5,036	7,251	231	33,821	0.1
MACERICH CO/THE	30,200	32,750	363	53,202	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,101	27,136	1,829	267,471	0.9
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,866	16,866	426	62,344	0.2
PUBLIC STORAGE	23,670	24,736	6,771	990,198	3.4
REGENCY CENTERS CORP	23,068	26,538	1,628	238,178	0.8
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,336	15,336	343	50,208	0.2
SL GREEN REALTY CORP	9,537	9,537	337	49,365	0.2
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884	23,884	70	10,372	0.0
UDR INC	46,541	48,632	1,883	275,336	0.9
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,338	36,338	1,109	162,269	0.6
CUBESMART	32,767	34,460	1,427	208,704	0.7
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	29,379	32,379	284	41,568	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	42,909	45,668	5,820	851,123	2.9
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,140	33,051	4,212	615,978	2.1
HERSHA HOSPITALITY TRUST-A	4,276	4,276	26	3,926	0.0
KITE REALTY GROUP TRUST	34,000	34,000	739	108,129	0.4
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	33,165	33,165	253	37,097	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	87,798	97,588	691	101,169	0.3
DOUGLAS EMMETT INC	23,532	26,346	354	51,852	0.2
ACADIA REALTY TRUST	14,653	14,653	210	30,788	0.1
ALEXANDER & BALDWIN INC	12,195	12,195	218	31,882	0.1

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末
	口数	口数	評価額		組入比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ALEXANDER'S INC	300	300	55	8,157	0.0
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,000	7,000	146	21,412	0.1
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	17,023	17,023	119	17,473	0.1
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,429	8,429	95	13,939	0.0
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400	8,400	19	2,874	0.0
CENTERSPACE	2,600	2,600	161	23,612	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	5,557	5,557	50	7,386	0.0
CITY OFFICE REIT INC	4,603	4,603	22	3,358	0.0
CLIPPER REALTY INC	800	800	4	686	0.0
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216	3,216	104	15,282	0.1
CTO REALTY GROWTH INC	3,839	3,839	65	9,582	0.0
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,869	15,924	211	30,991	0.1
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276	21,276	173	25,323	0.1
EQUITY COMMONWEALTH	14,758	17,598	336	49,250	0.2
FARMLAND PARTNERS INC	9,324	7,194	79	11,592	0.0
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115	15,115	28	4,177	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368	5,368	69	10,203	0.0
GLADSTONE LAND CORP	4,464	4,464	70	10,260	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	13,146	19,113	204	29,931	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,642	12,642	117	17,209	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	32,400	36,893	602	88,038	0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274	6,274	25	3,797	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,822	4,322	330	48,351	0.2
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,732	13,122	434	63,470	0.2
NETSTREIT CORP	8,448	8,448	144	21,184	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529	3,529	131	19,242	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,538	9,538	67	9,888	0.0
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352	2,352	45	6,692	0.0
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,902	19,902	128	18,857	0.1
SAFEHOLD INC/OLD	3,366	-	-	-	-
SAUL CENTERS INC	2,331	2,331	85	12,437	0.0
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098	14,098	77	11,358	0.0
UMH PROPERTIES INC	6,284	11,316	165	24,190	0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344	1,344	62	9,161	0.0
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,208	-	-	-	-
WP CAREY INC	30,766	33,806	2,183	319,226	1.1
ELME COMMUNITIES	15,190	15,190	233	34,115	0.1

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘 柄		期首(前期末)		期 末		組 入 比 率
		口 数	口 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
WHITESTONE REIT		4,511	4,511	43	6,358	0.0
BRT APARTMENTS CORP		500	500	9	1,367	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC		4,774	4,774	107	15,706	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	3,814,372	4,004,260	151,693	22,180,602	75.6
	銘 柄 数 <比 率>	145銘柄	142銘柄		<75.6%>	
<b>(カナダ)</b>		口	口	千カナダ・ドル	千円	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		8,107	8,107	144	15,518	0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		1,447	1,447	19	2,054	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		10,500	9,193	133	14,341	0.0
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T		13,622	6,841	22	2,430	0.0
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES		11,377	11,377	28	3,074	0.0
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM		1,387	1,387	4	497	0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT		4,345	4,345	33	3,625	0.0
PRIMARIS REIT		6,318	6,318	82	8,903	0.0
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T		2,642	3,187	52	5,647	0.0
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		9,662	9,662	66	7,167	0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E		2,725	4,023	44	4,742	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT		23,858	23,858	312	33,673	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		10,639	10,639	137	14,809	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		17,899	23,474	317	34,218	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		14,775	14,775	206	22,269	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		4,448	5,260	383	41,265	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		11,198	11,198	137	14,756	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		1,557	1,557	24	2,620	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		20,754	20,754	132	14,300	0.0
SLATE OFFICE REIT		3,663	3,663	5	638	0.0
SLATE GROCERY REIT-CL U		3,196	3,196	41	4,438	0.0
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		4,770	4,770	11	1,273	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		12,000	12,000	289	31,186	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		12,440	12,440	593	63,843	0.2
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		16,425	21,001	216	23,355	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		21,805	21,805	419	45,213	0.2
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		5,465	5,465	71	7,660	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		3,190	3,190	213	23,010	0.1
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		8,800	8,800	180	19,450	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	269,014	273,732	4,328	465,988	1.6
	銘 柄 数 <比 率>	29銘柄	29銘柄		<1.6%>	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首(前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評 価 額		組 入 比 率
						外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		口	口	千オーストラリア・ドル		千円		
SCENTRE GROUP		775,372	801,211	2,203	206,738	0.7		
REGION RE LTD		191,819	191,819	412	38,696	0.1		
CROMWELL PROPERTY GROUP		158,718	218,718	107	10,055	0.0		
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		30,439	52,361	125	11,742	0.0		
NATIONAL STORAGE REIT		162,000	208,817	482	45,260	0.2		
WAYPOINT REIT		113,111	113,111	286	26,851	0.1		
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		37,955	72,491	202	18,977	0.1		
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		84,443	84,443	256	24,086	0.1		
GDI PROPERTY GROUP		43,204	83,204	52	4,879	0.0		
ARENA REIT		45,981	45,981	170	15,963	0.1		
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		25,921	25,921	78	7,393	0.0		
RURAL FUNDS GROUP		52,739	52,739	103	9,748	0.0		
INGENIA COMMUNITIES GROUP		62,840	62,840	253	23,761	0.1		
DEXUS INDUSTRIA REIT		30,237	30,237	82	7,717	0.0		
CHARTER HALL LONG WALE REIT		97,225	97,225	341	32,020	0.1		
CENTURIA OFFICE REIT		43,559	68,559	88	8,330	0.0		
CENTURIA CAPITAL GROUP		104,758	104,758	150	14,154	0.0		
HOMEKO DAILY NEEDS REIT		239,155	239,155	285	26,815	0.1		
DEXUS/AU		164,087	168,087	1,292	121,283	0.4		
HMC CAPITAL LTD		33,678	33,678	180	16,969	0.1		
HEALTHCO REIT		51,410	51,410	76	7,139	0.0		
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE		89,106	89,106	64	6,019	0.0		
ABACUS STORAGE KING		—	50,980	60	5,668	0.0		
BWP TRUST		66,965	66,965	241	22,682	0.1		
GPT GROUP		286,000	305,971	1,263	118,569	0.4		
CHARTER HALL RETAIL REIT		62,449	91,686	313	29,421	0.1		
MIRVAC GROUP		584,278	634,643	1,491	139,939	0.5		
STOCKLAND		362,655	370,014	1,561	146,511	0.5		
ABACUS GROUP		50,980	50,980	59	5,596	0.0		
GOODMAN GROUP		252,546	265,983	5,971	560,288	1.9		
VICINITY CENTRES		591,192	591,192	1,081	101,512	0.3		
CHARTER HALL GROUP		73,143	73,143	784	73,571	0.3		
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,967,965 31銘柄	5,397,428 32銘柄	20,125	1,888,368 < 6.4% >	6.4		
(香港)		口	口	千香港・ドル		千円		
CHAMPION REIT		373,000	277,000	698	13,011	0.0		
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		110,000	110,000	293	5,474	0.0		

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首(前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率	
						外貨建金額		邦貨換算金額
PROSPERITY REIT		178,000		178,000		279	5,209	0.0
LINK REIT		377,400		403,700		15,643	291,592	1.0
LINK REIT	-RIGHTS	75,480		—		—	—	—
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		293,000		293,000		451	8,410	0.0
FORTUNE REIT		208,000		259,000		1,282	23,897	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	1,614,880		1,520,700		18,647	347,595	1.2
	銘 柄 数 <比 率>	7銘柄		6銘柄			< 1.2%>	
(シンガポール)		口		口		千シンガポール・ドル	千円	
FRASERS LOGISTICS & COMMERC		433,738		433,738		511	55,183	0.2
PARAGON REIT		115,700		215,200		194	20,998	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		273,200		324,500		713	76,972	0.3
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		176,400		176,400		43	4,659	0.0
FRASERS CENTREPOINT TRUST		141,800		166,800		360	38,846	0.1
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		190,000		190,000		120	13,008	0.0
KEPPEL DC REIT		200,100		200,100		426	45,954	0.2
EC WORLD REIT		52,800		52,800		15	1,707	0.0
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST		44,500		44,500		25	2,782	0.0
CAPITALAND ASCENDAS REIT		494,600		515,700		1,402	151,239	0.5
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		778,808		778,808		1,464	157,865	0.5
SUNTEC REIT		324,800		324,800		389	42,023	0.1
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		495,150		495,150		807	87,020	0.3
KEPPEL REIT		275,800		275,800		239	25,870	0.1
CAPITALAND ASCOTT TRUST		260,055		318,755		325	35,055	0.1
ESR-LOGOS REIT		864,913		1,097,413		334	36,088	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS		159,550		159,550		173	18,750	0.1
CAPITALAND CHINA TRUST		205,700		205,700		186	20,071	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		69,800		69,800		261	28,221	0.1
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST		355,000		355,000		539	58,179	0.2
STARHILL GLOBAL REIT		138,200		195,000		93	10,091	0.0
AIMS APAC REIT		113,300		113,300		139	15,025	0.1
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		66,700		66,700		46	4,962	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		502,900		502,900		118	12,742	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		262,000		262,000		154	16,666	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	6,995,514		7,540,414		9,089	979,992	3.3
	銘 柄 数 <比 率>	25銘柄		25銘柄			< 3.3%>	
(ニュージーランド)		口		口		千ニュージーランド・ドル	千円	
KIWI PROPERTY GROUP LTD		200,506		200,506		180	15,620	0.1



外国リート・インデックス・マザーファンド

銘 柄	期首(前期末)		期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		組 入 比 率	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
ARGOSY PROPERTY LTD	153,482	153,482	181	15,743	0.1	
STRIDE PROPERTY GROUP	90,554	90,554	130	11,287	0.0	
PRECINCT PROPERTIES GROUP	—	217,149	274	23,777	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	77,686	77,686	176	15,264	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	154,373	163,249	363	31,441	0.1	
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	192,441	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	869,042	902,626	1,306	113,133	0.4
	銘 柄 数 < 比 率 >	6銘柄	6銘柄		< 0.4% >	
(イギリス)	口	口	千イギリス・ポンド	千円		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	259,000	288,959	396	72,994	0.2	
ASSURA PLC	472,915	472,915	211	38,921	0.1	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	141,905	170,834	304	56,145	0.2	
UNITE GROUP PLC/THE	62,834	62,834	584	107,649	0.4	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	31,848	31,848	267	49,256	0.2	
HOME REIT PLC	96,051	96,051	36	6,720	0.0	
PRS REIT PLC/THE	89,207	89,207	64	11,957	0.0	
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	—	48,662	33	6,164	0.0	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	76,400	76,400	88	16,204	0.1	
WAREHOUSE REIT PLC	72,100	72,100	59	10,885	0.0	
CLS HOLDINGS PLC	41,598	41,598	51	9,512	0.0	
HELICAL PLC	—	17,000	39	7,308	0.0	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	125,000	304,853	356	65,671	0.2	
LAND SECURITIES GROUP PLC	116,859	116,859	686	126,428	0.4	
SEGRE PLC	179,959	190,440	1,377	253,651	0.9	
HAMMERSON PLC	591,835	591,835	146	26,915	0.1	
BRITISH LAND CO PLC	135,414	150,571	476	87,688	0.3	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	41,616	41,616	170	31,430	0.1	
DERWENT LONDON PLC	16,800	17,263	320	58,928	0.2	
WORKSPACE GROUP PLC	20,210	20,210	100	18,471	0.1	
SHAFTESBURY PLC	43,000	—	—	—	—	
BIG YELLOW GROUP PLC	26,200	26,200	276	50,892	0.2	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141	57,141	38	7,133	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847	117,847	61	11,326	0.0	
NEWRIVER REIT PLC	46,021	46,021	37	6,838	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	108,964	—	—	—	—	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770	34,770	20	3,700	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422	187,422	139	25,708	0.1	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首(前期末)		期		末	
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率
						外貨建金額	
CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE		84,958	84,958	70	12,889	0.0	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		95,000	95,000	82	15,182	0.1	
AEW UK REIT PLC		9,000	9,000	8	1,570	0.0	
LXI REIT PLC		247,814	247,814	226	41,612	0.1	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		182,000	212,067	194	35,765	0.1	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		41,816	88,651	78	14,396	0.0	
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST		53,280	53,280	24	4,522	0.0	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		70,698	70,698	29	5,375	0.0	
BALANCED COMM PROPERTY TRUST		154,750	154,750	103	19,090	0.1	
REGIONAL REIT LTD		45,664	45,664	19	3,665	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,177,896 36銘柄	4,433,338 36銘柄	7,183	1,322,577 < 4.5%>	4.5	
(イスラエル)		口	口	千イスラエル・シュケル	千円		
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT		31,012	36,242	287	11,093	0.0	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD		110,000	110,000	170	6,587	0.0	
REIT 1 LTD		26,169	29,102	473	18,257	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	167,181 3銘柄	175,344 3銘柄	932	35,937 < 0.1%>	0.1	
(韓国)		口	口	千韓国・ウォン	千円		
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		6,226	6,226	32,935	3,636	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L		24,000	24,000	94,560	10,439	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		4,067	4,067	17,650	1,948	0.0	
D&D PLATFORM REIT CO LTD		6,350	6,350	18,859	2,082	0.0	
SK REITS CO LTD		12,831	12,831	55,558	6,133	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD		12,561	12,561	38,625	4,264	0.0	
E KOCREF CR-REIT CO LTD		8,422	8,422	41,688	4,602	0.0	
SK REITS CO LTD-RIGHTS		-	4,803	701	77	0.0	
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1		9,815	17,727	71,262	7,867	0.0	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		8,762	8,762	52,747	5,823	0.0	
LOTTE REIT CO LTD		20,121	20,121	68,210	7,530	0.0	
JR REIT XXVII		19,000	19,000	73,055	8,065	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	132,155 11銘柄	144,870 12銘柄	565,854	62,470 < 0.2%>	0.2	
(ユーロ・・・アイルランド)		口	口	千ユーロ	千円		
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		62,588	62,588	60	9,593	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	62,588 1銘柄	62,588 1銘柄	60	9,593 < 0.0%>	0.0	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首(前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率	
						外貨建金額		邦貨換算金額
<b>(ユーロ・・・オランダ)</b>			口		口	千ユーロ	千円	
	NSI NV		2,966		2,966	55	8,783	0.0
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		6,975		6,975	152	24,069	0.1
	WERELDHAVE NV		5,522		5,522	87	13,799	0.0
	VASTNED RETAIL NV		2,035		2,919	57	9,086	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		17,498		18,382	353	55,739	0.2
	銘 柄 数 <比 率>		4銘柄		4銘柄		< 0.2%>	
<b>(ユーロ・・・ベルギー)</b>			口		口	千ユーロ	千円	
	MONTEA NV		1,880		1,880	136	21,605	0.1
	RETAIL ESTATES		1,586		2,065	117	18,580	0.1
	AEDIFICA		5,710		7,278	427	67,440	0.2
	COFINIMMO		4,455		4,682	325	51,367	0.2
	WAREHOUSES DE PAUW SCA		23,590		24,334	622	98,338	0.3
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS		4,899		4,899	67	10,656	0.0
	CARE PROPERTY INVEST		7,476		5,582	69	10,961	0.0
	XIOR STUDENT HOUSING NV		2,441		3,590	95	15,131	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額		52,037		54,310	1,862	294,083	1.0
	銘 柄 数 <比 率>		8銘柄		8銘柄		< 1.0%>	
<b>(ユーロ・・・フランス)</b>			口		口	千ユーロ	千円	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		16,000		16,472	783	123,668	0.4
	ICADE		4,873		4,873	159	25,216	0.1
	GECINA SA		8,220		8,692	823	130,008	0.4
	KLEPIERRE		29,107		29,963	707	111,721	0.4
	COVIVIO		7,002		7,454	313	49,491	0.2
	ALTAREA		723		723	62	9,849	0.0
	CARMILA		7,172		10,208	148	23,398	0.1
	MERCIALYS		11,000		11,000	89	14,065	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		84,097		89,385	3,087	487,419	1.7
	銘 柄 数 <比 率>		8銘柄		8銘柄		< 1.7%>	
<b>(ユーロ・・・ドイツ)</b>			口		口	千ユーロ	千円	
	HAMBORNER REIT AG		10,700		10,700	68	10,877	0.0
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG		1,380		1,380	6	1,073	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		12,080		12,080	75	11,951	0.0
	銘 柄 数 <比 率>		2銘柄		2銘柄		< 0.0%>	
<b>(ユーロ・・・スペイン)</b>			口		口	千ユーロ	千円	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		49,800		52,906	423	66,897	0.2
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		44,900		44,900	240	37,991	0.1

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄		期首(前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評 価 額		組 入 比 率
						外貨建金額	邦貨換算金額	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		6,940		6,940		39	6,244	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	101,640		104,746		703	111,133	0.4
	銘柄 数 <比率>	3銘柄		3銘柄		< 0.4%>		
(ユーロ・・・イタリア)		口		口		千ユーロ	千円	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		7,889		7,889		18	2,851	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	7,889		7,889		18	2,851	0.0
	銘柄 数 <比率>	1銘柄		1銘柄		< 0.0%>		
(ユーロ・・・その他)		口		口		千ユーロ	千円	
CROMWELL REIT EUR		48,320		48,320		70	11,060	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	48,320		48,320		70	11,060	0.0
	銘柄 数 <比率>	1銘柄		1銘柄		< 0.0%>		
ユーロ通貨計		386,149		397,700		6,232	983,832	3.4
		28銘柄		28銘柄		< 3.4%>		
合 計	口 数 ・ 金 額	23,394,168		24,790,412		—	28,380,500	96.7
	銘柄 数 <比率>	321銘柄		319銘柄		<96.7%>		

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

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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

## ■ 投資信託財産の構成

(2023年8月25日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円	%
	28,380,500	96.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	976,163	3.3
投 資 信 託 財 産 総 額	29,356,663	100.0

※期末における外貨建資産（29,231,988千円）の投資信託財産総額（29,356,663千円）に対する比率は99.6%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=146.22円、1カナダ・ドル=107.66円、1オーストラリア・ドル=93.83円、1香港・ドル=18.64円、1シンガポール・ドル=107.82円、1ニュージーランド・ドル=86.56円、1イギリス・ポンド=184.12円、1イスラエル・シケル=38.559円、100韓国・ウォン=11.04円、1ユーロ=157.86円です。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年8月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	29,443,963,589円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	900,389,168
投 資 証 券 (評価額)	28,380,500,219
未 収 入 金	91,733,015
未 収 配 当 金	71,341,187
(B) 負 債	107,921,219
未 払 金	87,342,907
未 払 解 約 金	20,577,715
そ の 他 未 払 費 用	597
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	29,336,042,370
元 本	10,010,216,682
次 期 繰 越 損 益 金	19,325,825,688
(D) 受 益 権 総 口 数	10,010,216,682口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	29,306円

※当期における期首元本額9,450,296,598円、期中追加設定元本額1,367,990,212円、期中一部解約元本額808,070,128円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

アセットアロケーション・ファンド (安定型)	13,398,410円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	19,774,737円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	57,234,466円
イオン・バランス戦略ファンド	39,837,848円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	8,058,170,927円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	7,982,163円
三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型)	34,590,661円
三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型)	35,439,615円
三井住友・資産最適化ファンド (3 バランス型)	145,174,840円
三井住友・資産最適化ファンド (4 やや成長型)	89,234,615円
三井住友・資産最適化ファンド (5 成長重視型)	66,261,111円
三井住友・DCつみたてNI SA・世界分散ファンド	111,070,726円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,034,158円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	348,185,898円
日興FWS・Gリートインデックス (為替ヘッジあり)	90,783,476円
日興FWS・Gリートインデックス (為替ヘッジなし)	607,054,099円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	113,238,651円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	7,339円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	7,706円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	9,541円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	11,376円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	11,376円

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1 (保守型)	30,436円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)	186,977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)	1,149,304円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)	641,752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)	418,418円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	34,437,633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>	53,358,742円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド2021-05 (リスク3%)<適格機関投資家限定>	81,479,681円

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

### ■ 損益の状況

(自2023年2月28日 至2023年8月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	600,428,867円
受 取 配 当 金	598,233,331
受 取 利 息	2,036,237
そ の 他 収 益 金	181,902
支 払 利 息	△ 22,603
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	430,286,911
売 買 益	2,816,100,487
売 買 損	△ 2,385,813,576
(C) そ の 他 費 用 等	△ 6,958,662
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	1,023,757,116
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	17,332,341,775
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 1,482,527,433
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,452,254,230
(H) 合 計 (D + E + F + G)	19,325,825,688
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	19,325,825,688

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

### ■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。