

■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
信託期間	無期限（設定日：2001年3月13日）
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本を含む世界各国の株式および公社債に投資し、各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。 ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。
主要投資対象	各ベビーファンドは以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 SMAM・国内株式バシッブ・ファンド（適格機関投資家専用） 日本の株式 SMAM・年金国内債券バシッブファンド<適格機関投資家限定> 日本の公社債 SMAM・外国株式バシッブ・ファンド（適格機関投資家専用） 日本を除く世界各国の株式 SMAM・年金外国債券バシッブ・ファンド<適格機関投資家限定> 日本を除く世界各国の債券 SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定> 円貨建ての短期公社債および短期金融商品
当ファンドの運用方法	■投資信託証券への投資を通じて、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います（グローバル・バランス型ファンド）。 ■各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。 ※各ファンドのターゲット・イヤーは次の通りです。 <2010>・・・西暦2010年 <2020>・・・西暦2020年 <2030>・・・西暦2030年 <2040>・・・西暦2040年
組入制限	■外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	■年1回（原則として毎年12月20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、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向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、収益分配を極力抑制します。 （基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

# 三井住友・ DC年金プラン・ファンド (ターゲット・イヤー型) 2010/2020/2030/2040

【運用報告書(全体版)】

(2018年12月21日から2019年12月20日まで)

第 19 期

決算日 2019年12月20日

## 受益者の皆さまへ

各ファンドは投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本を含む世界各国の株式および公社債に投資し、各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

 **三井住友DSアセットマネジメント**  
(旧:三井住友アセットマネジメント)  
〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1  
<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

フリーダイヤル 0120-88-2976  
受付時間：午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）

## ■最近5期の運用実績

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

決算期	基準価額 (分配落)			投資信託証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	期中騰落率		
15期(2015年12月21日)	12,346	0	0.3	99.4	524
16期(2016年12月20日)	12,457	0	0.9	99.7	553
17期(2017年12月20日)	12,663	0	1.7	99.7	527
18期(2018年12月20日)	12,491	0	△1.4	99.8	504
19期(2019年12月20日)	12,755	0	2.1	99.4	463

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

決算期	基準価額 (分配落)			投資信託証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	期中騰落率		
15期(2015年12月21日)	14,395	0	1.2	99.2	1,219
16期(2016年12月20日)	14,620	0	1.6	99.8	1,350
17期(2017年12月20日)	15,080	0	3.1	99.7	1,407
18期(2018年12月20日)	14,809	0	△1.8	99.9	1,344
19期(2019年12月20日)	15,214	0	2.7	99.5	1,307

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

決算期	基準価額 (分配落)			投資信託証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	期中騰落率		
15期(2015年12月21日)	15,141	0	2.2	99.6	1,197
16期(2016年12月20日)	15,465	0	2.1	99.8	1,379
17期(2017年12月20日)	16,512	0	6.8	99.8	1,688
18期(2018年12月20日)	15,856	0	△4.0	99.9	1,655
19期(2019年12月20日)	16,885	0	6.5	99.5	1,846

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

決算期	基準価額 (分配落)			投資信託証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	期中騰落率		
15期(2015年12月21日)	15,742	0	3.2	99.0	1,837
16期(2016年12月20日)	16,160	0	2.7	99.8	2,076
17期(2017年12月20日)	17,845	0	10.4	99.8	2,421
18期(2018年12月20日)	16,732	0	△6.2	100.0	2,468
19期(2019年12月20日)	18,299	0	9.4	99.6	2,887

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※各ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載していません。

## ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首)	円	%	%
2018年12月20日	12,491	—	99.8
12月末	12,453	△0.3	99.8
2019年1月末	12,522	0.2	99.7
2月末	12,603	0.9	99.9
3月末	12,636	1.2	99.9
4月末	12,650	1.3	99.5
5月末	12,590	0.8	99.7
6月末	12,651	1.3	99.8
7月末	12,685	1.6	99.8
8月末	12,684	1.5	99.8
9月末	12,714	1.8	100.0
10月末	12,729	1.9	99.8
11月末	12,760	2.2	100.2
(期 末)			
2019年12月20日	12,755	2.1	99.4

### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首)	円	%	%
2018年12月20日	14,809	—	99.9
12月末	14,728	△0.5	98.3
2019年1月末	14,841	0.2	99.9
2月末	14,967	1.1	100.0
3月末	15,033	1.5	100.0
4月末	15,045	1.6	99.7
5月末	14,965	1.1	100.0
6月末	15,068	1.7	99.9
7月末	15,122	2.1	99.9
8月末	15,147	2.3	99.9
9月末	15,175	2.5	100.0
10月末	15,187	2.6	100.0
11月末	15,230	2.8	100.2
(期 末)			
2019年12月20日	15,214	2.7	99.5

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首)	円	%	%
2018年12月20日	15,856	—	99.9
12月末	15,674	△1.1	99.7
2019年1月末	15,928	0.5	99.8
2月末	16,235	2.4	99.9
3月末	16,294	2.8	99.9
4月末	16,406	3.5	99.4
5月末	16,128	1.7	99.4
6月末	16,318	2.9	99.8
7月末	16,441	3.7	99.9
8月末	16,301	2.8	99.8
9月末	16,556	4.4	100.0
10月末	16,701	5.3	99.8
11月末	16,850	6.3	100.0
(期 末)			
2019年12月20日	16,885	6.5	99.5

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首)	円	%	%
2018年12月20日	16,732	—	100.0
12月末	16,435	△1.8	99.8
2019年1月末	16,816	0.5	99.7
2月末	17,289	3.3	100.0
3月末	17,295	3.4	99.7
4月末	17,525	4.7	99.7
5月末	17,015	1.7	99.9
6月末	17,259	3.1	99.7
7月末	17,439	4.2	99.8
8月末	17,061	2.0	100.0
9月末	17,609	5.2	100.0
10月末	17,925	7.1	100.0
11月末	18,185	8.7	100.3
(期 末)			
2019年12月20日	18,299	9.4	99.6

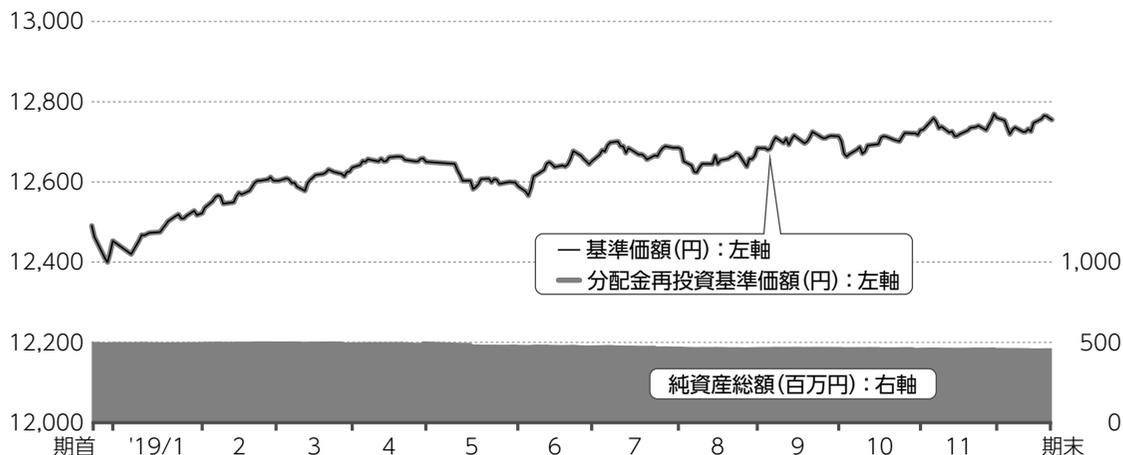
※騰落率は期首比です。

# 1 運用経過

基準価額等の推移について(2018年12月21日から2019年12月20日まで)

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

### 基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	12,491円
期末	12,755円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+2.1% (分配金再投資ベース)

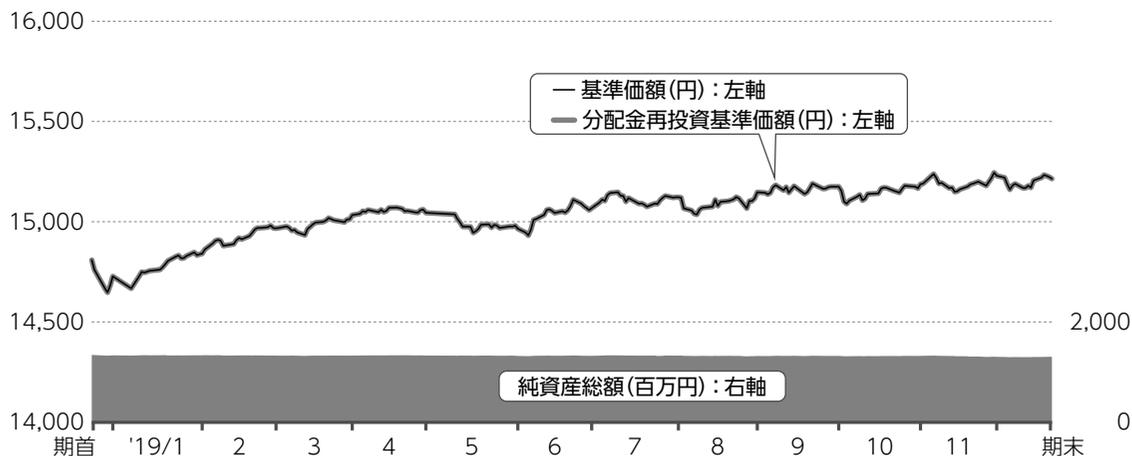
### 分配金再投資基準価額について

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

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

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

### 基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	14,809円
期末	15,214円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+2.7% (分配金再投資ベース)

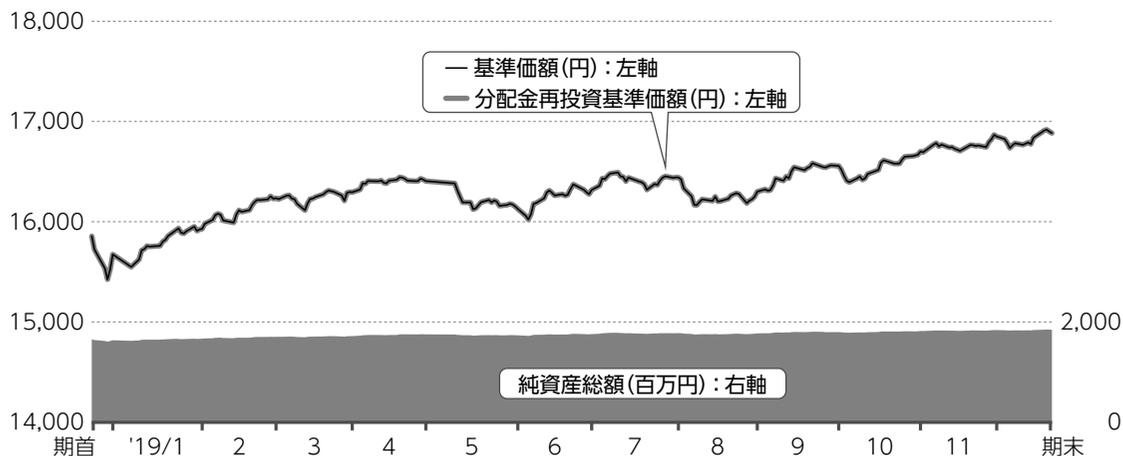
### 分配金再投資基準価額について

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

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

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

### 基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、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	15,856円
期末 (分配金0円(税引前)込み)	16,885円
騰落率 (分配金再投資ベース)	+6.5%

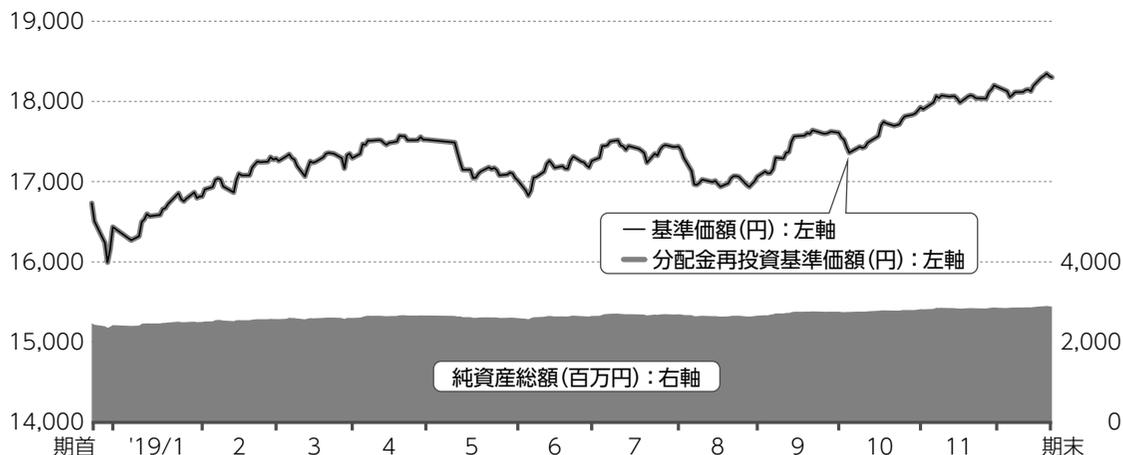
### 分配金再投資基準価額について

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)

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

## 基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、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	16,732円
期末	18,299円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	+9.4% (分配金再投資ベース)

## 分配金再投資基準価額について

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

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

**基準価額の主な変動要因(2018年12月21日から2019年12月20日まで)**

**三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040**

各ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、実質的に日本を含む世界各国の株式および公社債に投資し、各ファンドのターゲット・イヤー<sup>\*</sup>に向けて運用を行いました。

**上昇要因**

- 内外株式市場が上昇基調で推移したこと
- 内外の債券利回りが低下(価格は上昇)したこと

**下落要因**

- 米ドルやユーロが円に対して下落基調で推移したこと

※各ファンドのターゲット・イヤーは次の通りです。

<2010>……西暦2010年、<2020>……西暦2020年

<2030>……西暦2030年、<2040>……西暦2040年

## 組入れファンドの状況

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

組入れファンド	投資資産	投資資産配分	期末組入比率
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	国内株式	5%	4.9%
SMAM・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	35%	34.8%
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	外国株式	5%	4.9%
SMAM・年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	5%	4.9%
SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	短期金融資産	50%	49.9%

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

組入れファンド	投資資産	投資資産配分	期末組入比率
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	国内株式	6%	6.0%
SMAM・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	53%	52.9%
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	外国株式	6%	5.9%
SMAM・年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	9%	8.8%
SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	短期金融資産	26%	25.9%

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

組入れファンド	投資資産	投資資産配分	期末組入比率
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	国内株式	19%	19.1%
SMAM・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	54%	53.6%
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	外国株式	13%	13.0%
SMAM・年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	12%	11.9%
SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	短期金融資産	2%	1.9%

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

組入れファンド	投資資産	投資資産配分	期末組入比率
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	国内株式	35%	35.1%
SMAM・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	36%	35.7%
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	外国株式	17%	17.0%
SMAM・年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	10%	9.9%
SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	短期金融資産	2%	1.9%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

## 投資環境について(2018年12月21日から2019年12月20日まで)

期を通してみると、内外株式市場は上昇しました。内外債券市場は長期金利が米欧・日本で低下しました。為替は米ドルやユーロが対円で下落しました。

## 国内株式市場

国内株式は、期初から2018年末にかけては、米国株の下落や米ドル安・円高などを受けて下落しました。年明け以降は、FRB(米連邦準備制度理事会)が利上げに慎重な姿勢に転じたことを好感して米国株式が反発、米ドルが円に対して持ち直したことなどもあり、2019年4月中旬にかけて国内株式も持ち直す動きとなりました。5月は米中が相互に追加関税の引上げを実施したことを受けて、世界的に株価が下落しました。6月から7月下旬にかけては米国の利下げ期待(米国は7月末に利下げ実施しました。)を背景とした海外株式の上昇に連れて国内株式も上昇基調で推移しましたが、一方で円高に伴う企業業績への懸念などが上値抑制要因となり、上昇幅は限定的でした。8月以降は、米国が対中関税第4弾の導入を表明したことで再び米中貿易摩擦の激化が懸念され、国内株式は下落しました。9月から期末にかけては、米中の貿易交渉に対する期待などを背景に、株価は上昇傾向で推移しました。12月には米中貿易交渉で第一段階の合意が発表され、株価の押し上げ要因になりました。

当期の市場の動きをTOPIX(東証株価

指数、配当込み)で見ると、期首に比べて17.1%上昇しました。

## 国内債券市場

日銀の金融緩和政策が続く中、米欧の債券利回りの低下に連れて、日本の長期債利回り(10年国債利回り)も期首から8月後半にかけて低下基調で推移しました。その後は期末にかけて、米中貿易協議進展期待などを受けた米欧債券利回りの上昇や、利益確定売りに押される形で、国内債券利回りは上昇基調で推移しました。

当期の市場の動きを10年国債利回りで見ると、期首0.027%から期末0.014%へと小幅低下しました。

## 外国株式市場

主要先進国の株式市場は、米国・欧州がともに上昇しました。

先進国外国株式は、期首から2018年末にかけて下落しました。年明けから4月末にかけては、米国の利上げ停止、12月までの大幅調整の反動、先行きの企業業績への期待感などを背景に、米国を中心に株価は底堅く推

移しました。5月には米中貿易摩擦に対する警戒感の高まりなどから株価が大幅に調整しました。6月から7月下旬にかけては、米国での金融緩和期待の高まりなどから、米国を中心に先進国外国株式は底堅く推移しました。8月には、米国が中国に対する新たな制裁関税の賦課を発表したことで米中貿易摩擦に再度焦点が当たり、株価が大きく調整しました。8月下旬から期末にかけては、米中貿易協議再開への期待感の高まりなどを背景に、株価が持ち直す動きになりました。

欧州株式は、英国のEU(欧州連合)離脱を巡る迷走やイタリアの政治情勢の混乱など欧州政治の不透明感などもくすぶりましたが、米国株式の上昇に連れる形で欧州株式も期を通してみれば底堅く推移しました。

当期の市場の動きをMSCIコクサイインデックス(配当込み、米ドルベース)で見ると、期首に比べて27.7%上昇しました。

---

## 外国債券市場

米国国債利回りは、期を通して低下しました。期首から2018年末にかけては、欧州や中国での経済指標の悪化や、原油価格の下落を受けて低下しました。12月のFOMC(米連邦公開市場委員会)では、同年4回目の政策金利の上げが実施されたものの、2019年の利上げ回数見通しが引き下げられたため、金利の低下要因となりました。年明け以降、しばらくもみあいが続きましたが、3月のFOMCでバランスシート縮小の早期停止が

示唆されたことを受けて将来的な利下げ見通しが広がり、債券利回りは再び低下しました。その後も8月後半まで、米中貿易摩擦に対する警戒感などを背景に、引き続き低下基調で推移しました。その後は期末にかけて、米中協議進展期待などを背景に、債券利回りは上昇基調で推移する展開となりました。

欧州では、英国のEU離脱を巡る迷走やイタリアの政治情勢の混乱といった欧州政治の不透明感などを背景に、ドイツの長期債利回りは、期初から8月後半にかけて低下基調で推移しました。その後、期末にかけては英国のEU離脱に対する不透明感が後退したことなどを背景に、利回りが上昇する動きとなりました。

当期の市場の動きを米国10年国債利回りで見ると、期首2.75%から期末1.92%へと低下し、ドイツ10年国債利回りで見ると、期首0.24%から期末-0.24%へと低下しました。

---

## 外国為替市場

### ●米ドル・円

米ドル・円は、期初から2018年末にかけては、世界的な株価下落の中で、米ドルが一時的に大きく下落しました。年明け以降は、株価が反発する中で、4月まで再び米ドルが上昇しました。5月以降は、米中貿易摩擦に対する懸念やFRBによる金融緩和観測の高まりなどを受け、8月後半にかけて、米ドルがじり安の展開となりました。その後は、米

国の株価上昇等も背景に、期末にかけて米ドルはじり高の展開となりました。

当期の、米ドル・円相場は、期首112円60銭から期末には109円43銭と3円17銭の米ドル安・円高となりました。

### ●ユーロ・円

ユーロ・円は、欧州政治の不透明感や欧州

債券利回りの低下等がユーロの下押し材料となりました。10月以降は米中貿易協議の進展期待などを背景にユーロがやや持ち直しましたが、ユーロは期を通してみれば全般に上値の重い展開でした。

当期のユーロ・円は、期首128円18銭から期末121円68銭と6円50銭のユーロ安・円高となりました。

## ポートフォリオについて(2018年12月21日から2019年12月20日まで)

### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

各ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産に国際分散投資を行いました。投資資産配分(基本資産配分)は、国内外の経済・金融市場動向見通し等の分析を基に、各資産クラスの期待収益率等を予測した結果、ターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率を計画値とし、原則1年(計算期間)毎に見直しました。当期の投資資産配分は、それぞれ以下の通りでした。

	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
2010	5%	35%	5%	5%	50%
2020	6%	53%	6%	9%	26%
2030	19%	54%	13%	12%	2%
2040	35%	36%	17%	10%	2%

---

**SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)**

**SMAM・年金国内債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>**

**SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)**

**SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>**

各ファンドはベンチマークの動きに連動する投資成果を目指した運用を行いました。

各ファンドのベンチマークは以下の通りです。

国内株式：TOPIX(東証株価指数、配当込み)

国内債券：NOMURA-BPI(総合)

外国株式：MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)

外国債券：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

---

**SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>**

円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指しました。

**ベンチマークとの差異について(2018年12月21日から2019年12月20日まで)**

各ファンドはベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

## 分配金について(2018年12月21日から2019年12月20日まで)

当期の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、各ファンドとも見送りとしたしました。

なお、収益分配に充てなかった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：円、1万口当たり、税引前)

項目	2010	2020	2030	2040
当期分配金	—	—	—	—
(対基準価額比率)	(—%)	(—%)	(—%)	(—%)
当期の収益	—	—	—	—
当期の収益以外	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	2,754	5,996	8,595	10,325

※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

### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

引き続き、投資信託証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式および公社債に国際分散投資を行うバランス型運用により、ターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

2019年12月決算日の翌営業日以降の資産配分方針は下記の通りです。

	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
2010	5%	35%	5%	5%	50%
2020	6%	45%	5%	7%	37%
2030	18%	56%	12%	12%	2%
2040	33%	38%	17%	10%	2%

SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

SMAM・年金国内債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

各ファンドとも、ベンチマークの動きに連動した投資成果を目指したパッシブ運用を行います。

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

## 3 お知らせ

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

### 合併について

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友DSアセットマネジメント株式会社に変更しました。

### 約款変更について

- 委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、所要の変更を行いました。(適用日：2019年4月1日)

## ■ 1万口当たりの費用明細(2018年12月21日から2019年12月20日まで)

### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2010

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	56円	0.440%	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) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(投信会社)	(8)	(0.066)	
(販売会社)	(42)	(0.330)	
(受託会社)	(6)	(0.044)	
(b) その他費用	0	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 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	56	0.443	

期中の平均基準価額は12,639円です。

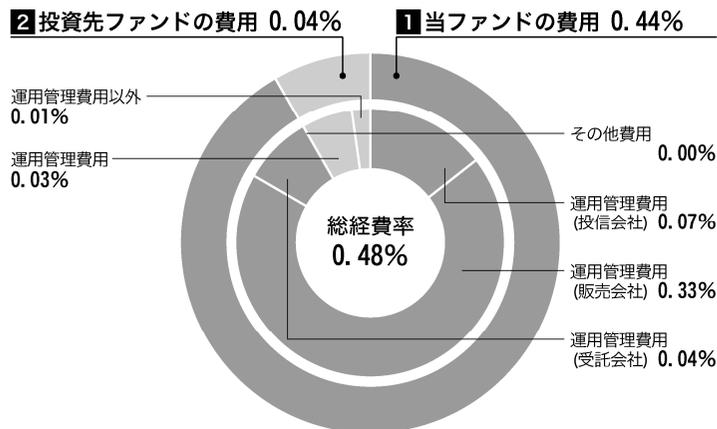
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※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。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。当該投資信託証券の費用は後掲の「1万口当たりの費用明細」をご覧ください。

## 参考情報 総経費率(年率換算)



<b>総経費率(1+2)</b>	<b>0.48%</b>
<b>1 当ファンドの費用の比率</b>	<b>0.44%</b>
投資先ファンドの 運用管理費用の比率	0.03%
<b>2 投資先ファンドの 運用管理費用以外の比率</b>	<b>0.01%</b>

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

- ※**1**の各費用は、前掲「1万円当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、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。「1万円当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。
- ※**2**の各費用は、投資先ファンド(当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く))の「1万円当たりの費用明細」をもとに、委託会社が年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。
- ※**1**と**2**の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。
- ※上記の前提条件で算出している参考値であり、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比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は0.48%です。

### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	81円	0.539%	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)
(投信会社)	(25)	(0.165)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(50)	(0.330)	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)	(7)	(0.044)	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) その他費用	1	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
(監査費用)	(0)	(0.003)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	82	0.542	

期中の平均基準価額は15,042円です。

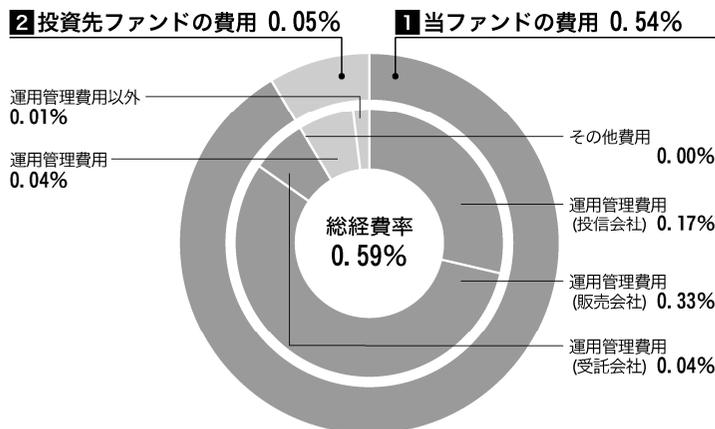
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万円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。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。当該投資信託証券の費用は後掲の「1万円当たりの費用明細」をご覧ください。

## 参考情報 総経費率（年率換算）



<b>総経費率 (① + ②)</b>	<b>0.59%</b>
<b>① 当ファンドの費用の比率</b>	0.54%
投資先ファンドの 運用管理費用の比率	0.04%
<b>② 投資先ファンドの 運用管理費用以外の比率</b>	0.01%

※ **①**の各費用は、前掲「1万円当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、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。「1万円当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※ **②**の各費用は、投資先ファンド（当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く））の「1万円当たりの費用明細」をもとに、委託会社が年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※ **①**と**②**の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。

※上記の前提条件で算出している参考値であり、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比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率（年率）は0.59%です。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	88円	0.539%	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) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(投信会社)	(27)	(0.165)	
(販売会社)	(54)	(0.330)	
(受託会社)	(7)	(0.044)	
(b) その他費用	1	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 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
(監査費用)	(1)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	89	0.542	

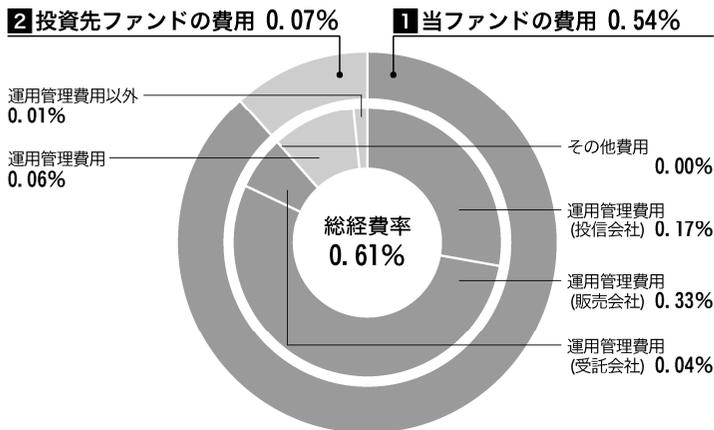
期中の平均基準価額は16,319円です。

※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。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。当該投資信託証券の費用は後掲の「1万口当たりの費用明細」をご覧ください。

参考情報 総経費率 (年率換算)



<b>総経費率 (1 + 2)</b>	<b>0.61%</b>
<b>1</b> 当ファンドの費用の比率	0.54%
投資先ファンドの 運用管理費用の比率	0.06%
<b>2</b> 投資先ファンドの 運用管理費用以外の比率	0.01%

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

- ※**1**の各費用は、前掲「1万円当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、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。「1万円当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。
- ※**2**の各費用は、投資先ファンド(当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く))の「1万円当たりの費用明細」をもとに、委託会社が年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。
- ※**1**と**2**の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。
- ※上記の前提条件で算出している参考値であり、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比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は0.61%です。

### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	93円	0.539%	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)
(a) 投信会社	(29)	(0.165)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(a) 販売会社	(57)	(0.330)	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
(a) 受託会社	(8)	(0.044)	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) その他費用	1	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
(b) 監査費用	(1)	(0.003)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
(b) その他	(0)	(0.000)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	94	0.542	

期中の平均基準価額は17,321円です。

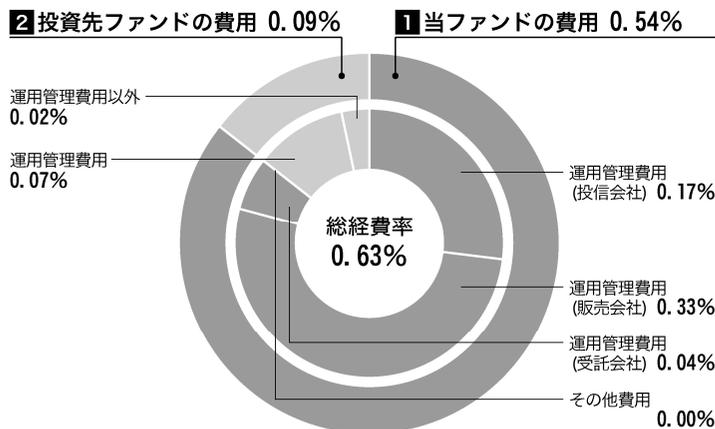
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万円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。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。当該投資信託証券の費用は後掲の「1万円当たりの費用明細」をご覧ください。

## 参考情報 総経費率（年率換算）



<b>総経費率(①+②)</b>	<b>0.63%</b>
<b>① 当ファンドの費用の比率</b>	0.54%
投資先ファンドの 運用管理費用の比率	0.07%
<b>② 投資先ファンドの 運用管理費用以外の比率</b>	0.02%

※ **①**の各費用は、前掲「1万円当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、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。「1万円当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※ **②**の各費用は、投資先ファンド（当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く））の「1万円当たりの費用明細」をもとに、委託会社が年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※ **①**と**②**の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。

※上記の前提条件で算出している参考値であり、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比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率（年率）は0.63%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2018年12月21日から2019年12月20日まで)

投資信託証券

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内		口	千円	口	千円
	SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,608,254	4,170	5,137,554	8,630
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,203,633	3,250	3,425,348	9,710
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	437,217	760	2,379,951	4,190
	SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,223,799	6,890	19,465,934	25,650
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	7,809,134	7,860	29,312,756	29,500
合 計		17,282,037	22,930	59,721,543	77,680

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内		口	千円	口	千円
	SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,417,586	5,500	25,424,755	40,010
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	5,724,567	14,530	11,065,779	30,550
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,211,457	3,850	14,564,936	25,330
	SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	18,367,158	24,270	112,221,910	146,200
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	120,673,307	121,490	12,999,401	13,080
合 計		150,394,075	169,640	176,276,781	255,170

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内		口	千円	口	千円
	SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	26,001,343	41,020	44,576,096	72,670
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	16,105,817	42,150	20,342,281	57,470
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	6,621,281	11,590	866,073	1,510
	SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	96,930,910	127,660	22,375,333	29,710
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	2,146,187	2,160	—	—
合 計		147,805,538	224,580	88,159,783	161,360

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内		口	千円	口	千円
	SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	72,641,236	116,080	77,034,670	127,450
	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	37,602,308	98,700	38,896,509	108,840
	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	21,299,529	37,480	10,600,382	18,470
	SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	165,986,234	218,850	52,456,211	69,490
	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	6,359,641	6,400	1,471,019	1,480
合 計		303,888,948	477,510	180,458,791	325,730

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 利害関係人との取引状況等(2018年12月21日から2019年12月20日まで)

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

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  
(2018年12月21日から2019年12月20日まで)

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010/2020/2030/2040

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(2019年12月20日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

ファンド名	期首(前期末)	期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	口	口	千円	%
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	15,119,229	12,589,929	22,830	4.9
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	9,568,521	7,346,806	22,503	4.9
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	14,519,980	12,577,246	22,606	4.9
SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	137,051,622	122,809,487	161,555	34.8
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	251,499,247	229,995,625	231,421	49.9
合 計	427,758,599	385,319,093	460,917	99.4

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

ファンド名	期首(前期末)	期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	口	口	千円	%
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	64,986,055	42,978,886	77,937	6.0
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	30,600,023	25,258,811	77,367	5.9
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	76,268,009	63,914,530	114,879	8.8
SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	619,591,738	525,736,986	691,607	52.9
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	228,707,910	336,381,816	338,467	25.9
合 計	1,020,153,735	994,271,029	1,300,260	99.5

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

ファンド名	期首(前期末)	期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	口	口	千円	%
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	213,055,545	194,480,792	352,671	19.1
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	82,684,546	78,448,082	240,286	13.0
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	116,064,681	121,819,889	218,959	11.9
SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	677,463,191	752,018,768	989,280	53.6
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	33,331,637	35,477,824	35,697	1.9
合 計	1,122,599,600	1,182,245,355	1,836,895	99.5

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

ファンド名	期首(前期末)	期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	口	口	千円	%
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	563,134,145	558,740,711	1,013,220	35.1
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	161,711,139	160,416,938	491,357	17.0
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	148,215,338	158,914,485	285,632	9.9
SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	669,383,442	782,913,465	1,029,922	35.7
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	50,694,333	55,582,955	55,927	1.9
合 計	1,593,138,397	1,716,568,554	2,876,060	99.6

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

■投資信託財産の構成

(2019年12月20日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	460,917	99.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,318	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	465,235	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	465,235,536円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	4,317,875
投資信託受益証券(評価額)	460,917,661
(B) 負 債	1,568,237
未 払 金	530,000
未 払 信 託 報 酬	1,030,570
未 払 利 息	9
そ の 他 未 払 費 用	7,658
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	463,667,299
元 本	363,521,029
次 期 繰 越 損 益 金	100,146,270
(D) 受 益 権 総 口 数	363,521,029口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	12,755円

※当期における期首元本額403,800,377円、期中追加設定元本額19,771,982円、期中一部解約元本額60,051,330円です。

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

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

■分配金のお知らせ

	当 期
1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	- 円

■損益の状況

(自2018年12月21日 至2019年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 997円
支 払 利 息	△ 997
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	11,414,311
売 益	12,479,982
売 買 損	△ 1,065,671
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,123,393
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	9,289,921
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	28,240,791
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	62,615,558
( 配 当 等 相 当 額 )	( 58,645,927)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 3,969,631)
(G) 計 (D + E + F)	100,146,270
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	100,146,270
追 加 信 託 差 損 益 金	62,615,558
( 配 当 等 相 当 額 )	( 58,645,927)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 3,969,631)
分 配 準 備 積 立 金	37,531,709
繰 越 損 益 金	△ 997

※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。  
 ※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※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。

※期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,455,077円)、信託約款に規定される収益調整金(62,614,561円)および分配準備積立金(34,076,632円)より分配可能額は100,146,270円(1万口当たり2,754円)ですが、分配は行っておりません。

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。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

## ■ 投資信託財産の構成

(2019年12月20日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	1,300,260	98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	14,580	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	1,314,840	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,314,840,119円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	12,580,106
投資信託受益証券(評価額)	1,300,260,013
未 収 入 金	2,000,000
(B) 負 債	7,619,392
未 払 金	4,040,000
未 払 解 約 金	20,802
未 払 信 託 報 酬	3,536,968
未 払 利 息	27
そ の 他 未 払 費 用	21,595
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,307,220,727
元 本	859,233,953
次 期 繰 越 損 益 金	447,986,774
(D) 受 益 権 総 口 数	859,233,953口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	15,214円

※当期における期首元本額907,805,185円、期中追加設定元本額41,370,908円、期中一部解約元本額89,942,140円です。

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

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

## ■ 分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金(税引前)	当 期
	- 円

## ■ 損益の状況

(自2018年12月21日 至2019年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 2,415円
支 払 利 息	△ 2,415
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	40,874,157
売 買 益	44,925,860
売 買 損	△ 4,051,703
(C) 信 託 報 酬 等	△ 7,098,427
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	33,773,315
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	153,413,510
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	260,799,949
( 配 当 等 相 当 額 )	( 328,091,808)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 67,291,859)
(G) 計 (D + E + F)	447,986,774
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	447,986,774
追 加 信 託 差 損 益 金	260,799,949
( 配 当 等 相 当 額 )	( 328,091,808)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 67,291,859)
分 配 準 備 積 立 金	187,189,240
繰 越 損 益 金	△ 2,415

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※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。

※期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(12,035,562円)、信託約款に規定される収益調整金(328,091,808円)および分配準備積立金(175,153,678円)より分配可能額は515,281,048円(1万口当たり5,996円)ですが、分配は行っておりません。

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。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

## ■投資信託財産の構成

(2019年12月20日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	1,836,895	99.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	16,987	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	1,853,882	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,853,882,810円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	16,987,324
投資信託受益証券(評価額)	1,836,895,486
(B) 負 債	7,064,970
未 払 金	2,210,000
未 払 解 約 金	20,697
未 払 信 託 報 酬	4,804,883
未 払 利 息	37
そ の 他 未 払 費 用	29,353
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,846,817,840
元 本	1,093,736,304
次 期 繰 越 損 益 金	753,081,536
(D) 受 益 権 総 口 数	1,093,736,304口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	16,885円

※当期における期首元本額1,043,801,134円、期中追加設定元本額105,554,123円、期中一部解約元本額55,618,953円です。

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

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

## ■分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当 期
	- 円

## ■損益の状況

(自2018年12月21日 至2019年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 4,566円
支 払 利 息	△ 4,566
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	117,161,960
売 益	121,229,799
売 買 損	△ 4,067,839
(C) 信 託 報 酬 等	△ 9,368,690
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	107,788,704
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	171,449,932
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	473,842,900
( 配 当 等 相 当 額 )	( 660,846,784)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△187,003,884)
(G) 計 (D + E + F)	753,081,536
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	753,081,536
追 加 信 託 差 損 益 金	473,842,900
( 配 当 等 相 当 額 )	( 660,846,784)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△187,003,884)
分 配 準 備 積 立 金	279,243,202
繰 越 損 益 金	△ 4,566

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※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。

※期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(44,775,271円)、信託約款に規定される収益調整金(660,846,784円)および分配準備積立金(234,467,931円)より分配可能額は940,089,986円(1万口当たり8,595円)ですが、分配は行っておりません。

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。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

## ■投資信託財産の構成

(2019年12月20日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	2,876,060	99.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	25,193	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	2,901,253	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	2,901,253,488円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	17,192,875
投資信託受益証券(評価額)	2,876,060,613
未 収 入 金	8,000,000
(B) 負 債	13,871,507
未 払 解 約 金	6,472,290
未 払 信 託 報 酬	7,354,219
未 払 利 息	37
そ の 他 未 払 費 用	44,961
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,887,381,981
元 本	1,577,910,109
次 期 繰 越 損 益 金	1,309,471,872
(D) 受 益 権 総 口 数	1,577,910,109口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	18,299円

※当期における期首元本額1,475,126,579円、期中追加設定元本額254,762,038円、期中一部解約元本額151,978,508円です。

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

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

## ■分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当 期
	-円

## ■損益の状況

(自2018年12月21日 至2019年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 7,355円
支 払 利 息	△ 7,355
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	246,874,845
売 買 益	258,587,782
売 買 損	△ 11,712,937
(C) 信 託 報 酬 等	△ 14,236,015
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	232,631,475
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	170,616,223
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	906,224,174
( 配 当 等 相 当 額 )	( 1,226,084,898)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 319,860,724)
(G) 計 (D + E + F)	1,309,471,872
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	1,309,471,872
追 加 信 託 差 損 益 金	906,224,174
( 配 当 等 相 当 額 )	( 1,226,084,898)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 319,860,724)
分 配 準 備 積 立 金	403,255,053
繰 越 損 益 金	△ 7,355

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※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。

※期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(90,075,762円)、信託約款に規定される収益調整金(1,226,084,898円)および分配準備積立金(313,179,291円)より分配可能額は1,629,339,951円(1万口当たり10,325円)ですが、分配は行っておりません。

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。

# SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

第 19 期

決算日 2019年12月2日

## ■当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2001年4月6日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、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す。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） 日本の取引所に上場している株式
当ファンドの運用方法	■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ます。 ■株式の実質組入比率は原則として高位を保ちます。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資は行いません。 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） ■株式への投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	年1回（毎年11月30日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、以下の方針に基づき収益分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

## ■ 1万口当たりの費用明細(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	14円	0.083%	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)
(a) 信託報酬			投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(a) 信託報酬			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
(a) 信託報酬			受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.005	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			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
(c) その他費用	1	0.006	その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数
(c) その他費用			監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
(c) その他費用			その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	16	0.094	

期中の平均基準価額は16,386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。

※売買委託手数料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。

## ■ 当期中の売買及び取引の状況(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	千口 202,814	千円 482,030	千口 2,350,063	千円 5,847,503

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ■ 組入れ資産の明細(2019年12月2日現在)

### 親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	千口 5,957,306	千口 3,810,058	千円 10,423,937

※国内株式インデックス・マザーファンド(B号)の期末の受益権総口数は63,743,430千口です。

※単位未満は切捨て。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年12月2日現在）

項 目	期 末
(A) 資 産	10,460,375,473円
コール・ローン等	17,694
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(評価額)	10,423,937,783
未 収 入 金	36,419,996
(B) 負 債	41,154,888
未 払 解 約 金	36,419,996
未 払 信 託 報 酬	4,417,079
そ の 他 未 払 費 用	317,813
(C) 純資産総額(A-B)	10,419,220,585
元 本	5,817,374,884
次 期 繰 越 損 益 金	4,601,845,701
(D) 受益権総口数	5,817,374,884口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	17,911円

※当期における期首元本額9,088,389,450円、期中追加設定元本額452,753,468円、期中一部解約元本額3,723,768,034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2018年12月1日 至2019年12月2日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 777円
支 払 利 息	△ 777
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	580,625,982
売 買 益	805,087,536
売 買 損	△ 224,461,554
(C) 信 託 報 酬 等	△ 10,622,771
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	570,002,434
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,583,484,017
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	448,359,250
( 配 当 等 相 当 額 )	( 3,557,341,822)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△3,108,982,572)
(G) 計 (D+E+F)	4,601,845,701
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	4,601,845,701
追 加 信 託 差 損 益 金	448,359,250
( 配 当 等 相 当 額 )	( 3,557,899,464)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△3,109,540,214)
分 配 準 備 積 立 金	4,487,897,878
繰 越 損 益 金	△ 334,411,427

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※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。

※期末における、費用控除後の配当等収益(233,157,577円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(3,557,899,464円)および分配準備積立金(4,254,740,301円)より分配可能額は8,045,797,342円(1万口当たり13,830円)ですが、分配は行っておりません。

# 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

第17期 (2018年12月1日から2019年12月2日まで)

信託期間	無期限 (設定日: 2003年2月17日)
運用方針	主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、T O P I X (東証株価指数、配当込み) の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) T O P I X (東証株価指数、配当込み)		株式組入率 株比	株式先物率 (買建-売建)	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
13期 (2015年11月30日)	円 23,013	% 13.3	2,200.15	% 13.3	% 98.0	% 1.9	百万円 224,719
14期 (2016年11月30日)	21,863	△ 5.0	2,091.95	△ 4.9	97.9	2.1	204,698
15期 (2017年11月30日)	27,242	24.6	2,604.86	24.5	98.5	1.5	193,025
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

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※T O P I X (東証株価指数) 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 株比	株式先物率 (買建-売建)
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2018年11月30日	円 25,937	% -	2,475.92	% -	% 97.1	% 2.8
12月末	23,280	△10.2	2,223.11	△10.2	98.3	1.8
2019年1月末	24,425	△ 5.8	2,332.52	△ 5.8	99.1	0.9
2月末	25,062	△ 3.4	2,393.08	△ 3.3	99.0	0.9
3月末	25,084	△ 3.3	2,395.21	△ 3.3	97.1	2.8
4月末	25,502	△ 1.7	2,434.82	△ 1.7	98.2	1.8
5月末	23,846	△ 8.1	2,275.96	△ 8.1	97.8	2.2
6月末	24,496	△ 5.6	2,338.89	△ 5.5	97.8	2.3
7月末	24,720	△ 4.7	2,360.18	△ 4.7	98.6	1.3
8月末	23,885	△ 7.9	2,280.58	△ 7.9	97.9	2.0
9月末	25,328	△ 2.3	2,418.29	△ 2.3	97.6	2.3
10月末	26,600	2.6	2,539.02	2.5	97.0	2.8
11月末	27,116	4.5	2,588.40	4.5	97.6	2.3
(期末) 2019年12月2日	27,359	5.5	2,611.46	5.5	97.7	2.3

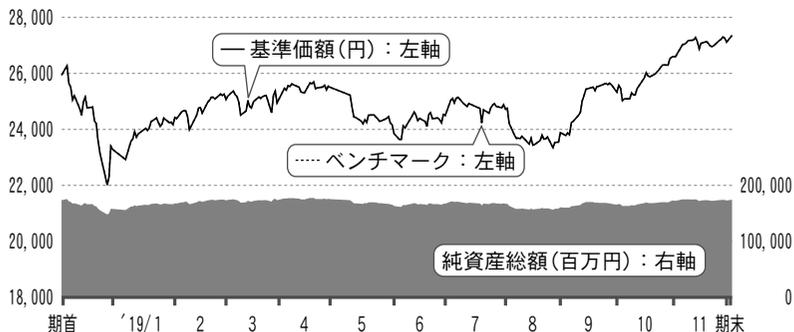
※騰落率は期首比です。

※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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

### 基準価額等の推移



期首	25,937円
期末	27,359円
騰落率	+5.5%

※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、TOPIX（東証株価指数、配当込み）です。

※TOPIX（東証株価指数）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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

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

### 上昇要因

- ・ 2018年12月下旬から2019年4月下旬にかけて、米中貿易摩擦問題に対する懸念の後退や中国の景気対策期待が高まったこと
- ・ 8月下旬から期末にかけて、トランプ米大統領が中国との貿易協議継続に前向きな姿勢を示したことや、世界景気や企業業績の底打ち回復期待が高まったこと

### 下落要因

- ・ 期首から12月下旬にかけて、低調な国内企業決算に加え、米国で金利上昇への警戒感の高まりなどから株式市場が急落し、世界的にリスク回避の動きが広がったこと
- ・ 4月下旬から8月下旬にかけて、再び米中貿易摩擦問題が激化したこと

### ▶ 投資環境について（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

国内株式市場は上昇しました。

期首から2018年12月下旬にかけては、低調な国内企業決算に加え、米国で金利上昇への警戒感の高まりなどから株式市場が急落し、世界的にリスク回避の動きが広がったことから、国内株式市場も大幅に下落しました。

12月下旬から2019年4月下旬にかけては、米中貿易摩擦問題に対する懸念の後退や中国の景気対策に対する期待が高まったことから、上昇しました。

4月下旬から8月下旬にかけては、5月の追加関税の相互引上げや8月の米国による新たな対中追加関税の導入発表など、米中貿易摩擦問題が激化したことなどが重石となり、軟調な推移となりました。

8月下旬から期末にかけては、トランプ米大統領が中国との貿易協議継続に前向きな姿勢を示したことなどから反発し、世界景気・企業業績の底打ち回復期待を背景に、上昇する展開となりました。

当期の市場の動きをベンチマークであるTOPIX（東証株価指数、配当込み）でみると、期首に比べて5.5%上昇しました。

### ▶ ポートフォリオについて（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

#### 株式組入比率

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

#### ポートフォリオの特性

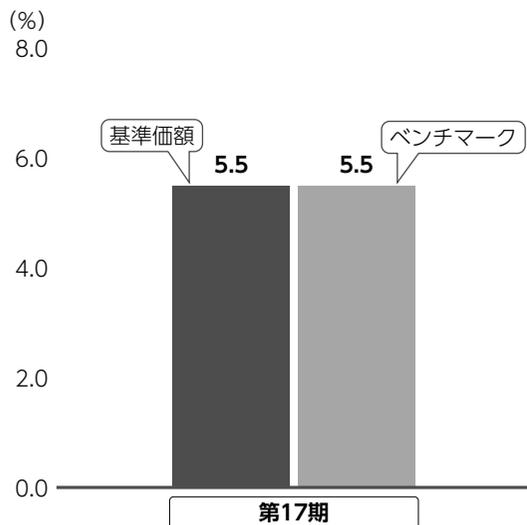
TOPIX（東証株価指数、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

東証1部上場銘柄のうち、流動性や信用リスクを考慮し、銘柄組入れを行いました。またファンドの資金流入出に機動的に対応するため、株式先物の売買を行いました。

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

▶ ベンチマークとの差異について（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



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+5.5%となり、ベンチマークの騰落率+5.5%を追随しました。

## 2 今後の運用方針

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

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

### ■ 1万口当たりの費用明細（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	1円 (0) (1)	0.005% (0.001) (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)	0.001 (0.001)	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	0.006	

期中の平均基準価額は25,021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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

#### (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株	千円	千株	千円
		8,251 (1,286)	14,919,624 ( )	8,990	18,015,919

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※（ ）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	T O P I X	百万円 43,587	百万円 44,780	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

### ■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	32,935,543千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	164,850,191千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.19

※単位未満は切捨て。

※(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。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

### ■ 利害関係人との取引状況等（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

#### (1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株 式	14,919	464	3.1	18,015	7,954	44.2
株 式 先 物 取 引	43,587	10,428	23.9	44,780	6,674	14.9

#### (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
株 式	110	162	1,955

#### (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	7,657千円
(b) うち利害関係人への支払額	1,075千円
(c) (b) / (a)	14.0%

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、株式会社関西みらいフィナンシャルグループ、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、NECキャピタルソリューション株式会社、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

（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

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

### ■ 組入れ資産の明細（2019年12月2日現在）

#### (1) 国内株式

銘 柄	期首(前期末)		期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	3.5	3.6		10,458
日本水産	96.8	95.8		63,802
マルハニチロ	14	13.8		40,544
カネコ種苗	4	4.3		6,544
サカタのタネ	11.5	10.9		38,531
ホクト	7.9	7.2		14,407
鉱業 (0.3%)				
日鉄鉱業	2.4	2.5		11,425
三井松島ホールディングス	4.9	3.3		3,969
国際石油開発帝石	389.5	384.9		408,571
石油資源開発	13.7	12.4		35,203
K&Oエナジーグループ	5.1	5.3		8,358

銘 柄	期首(前期末)		期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
建設業 (2.8%)				
ヒノキヤグループ	2.6	3.2		7,145
ショーボンドホールディングス	7.5	13.5		57,510
ミライト・ホールディングス	24.1	27.6		45,208
タマホーム	7.2	5.5		10,131
TATERU	12.5	-		-
スペースバリューホールディングス	12.8	13.8		7,107
安藤・間	61.7	57.3		51,856
東急建設	28.4	28		21,952
コムシスホールディングス	34.3	33.8		107,822
ミサワホーム	9.3	8.5		10,183
ビーアールホールディングス	10.5	13		6,292
高松コンストラクショングループ	6	6		16,398
東建コーポレーション	2.9	2.8		20,440

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
大成建設	79.5	73.4	318,923	
大林組	239	220.7	260,426	
清水建設	243.6	223.8	238,347	
飛鳥建設	7.5	8	11,760	
長谷工コーポレーション	99.8	84.4	120,523	
松井建設	10.8	11.2	8,758	
銭高組	1.3	1.3	5,206	
鹿島建設	187	172.2	251,412	
不動テトラ	7	7	10,801	
大末建設	5.4	5.4	5,205	
鉄建建設	5.1	5.1	14,514	
西松建設	17.8	17.7	43,081	
三井住友建設	59.3	56	34,160	
大豊建設	5.5	5.1	15,294	
前田建設工業	57.8	56.7	56,359	
奥村組	13.6	12.6	38,997	
東鉄工業	9.4	9	29,475	
浅沼組	3.2	3	13,125	
戸田建設	93.4	92.7	63,221	
熊谷組	11.4	10.3	33,732	
北野建設	2.2	2	5,212	
矢作建設工業	13.1	12.1	9,244	
ピーエス三菱	11.1	10.6	7,409	
日本ハウスホールディングス	18.3	20	9,640	
大東建託	28.6	26.5	353,907	
新日本建設	10.2	10.4	9,651	
NIPPON	20.6	17.7	39,931	
東亜道路工業	2.2	1.8	6,219	
前田道路	25.2	23.2	60,366	
日本道路	2.3	2.3	16,123	
東亜建設工業	7.5	8.3	13,089	
日本国土開発	—	15	9,390	
若築建設	5.8	5.3	9,015	
東洋建設	32.3	26.1	13,154	
五洋建設	96.4	89.3	56,884	
世紀東急工業	14.8	13.3	11,757	
福田組	2.8	2.8	13,510	
住友林業	56.5	55.3	88,148	
日本基礎技術	—	12.2	4,916	
巴コーポレーション	16	14.4	5,745	
大和ハウス工業	221.4	218.4	741,468	
ライト工業	15.6	12.6	19,996	
積水ハウス	245.5	241.5	578,271	
日特建設	8.7	—	—	
ユアテック	13.3	13.8	9,342	
中電工	9.6	8.2	21,172	
関電工	35	29.2	30,776	
きんでん	52.8	51.8	85,936	
東京エネクス	9.1	9.4	8,817	
トーエネック	2.8	2.9	10,556	
住友電設	6.2	6.3	15,554	
日本電設工業	13.2	11.2	25,401	
協和エクシオ	31.3	33.3	95,804	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
新日本空調	7.5	6.1	13,676	
九電工	15.8	15.5	54,947	
三機工業	18.2	15.7	23,236	
日揮ホールディングス	69	68.6	111,269	
中外炉工業	3.1	3.2	5,465	
ヤマト	10	9.4	6,786	
太平電業	5.5	5.7	13,298	
高砂熱学工業	19.7	18.6	35,358	
朝日工業社	2.3	2.1	7,287	
明星工業	14.8	14.7	13,671	
大気社	10.9	10.7	39,643	
ダイダン	5.6	5.5	14,476	
日比谷総合設備	7.9	7.4	14,422	
東芝プラントシステム	17	17	45,288	
OSJBホールディングス	40.7	41.7	11,300	
レイズネクスト	15.1	12.6	15,649	
食料品（3.9%）				
日本製粉	22.6	20.2	34,663	
日清製粉グループ本社	79.9	79.4	163,405	
日東富士製粉	0.6	—	—	
昭和産業	6.3	6.1	19,703	
鳥越製粉	9.1	8.5	8,032	
中部飼料	9.2	8.9	12,371	
フィード・ワン	52.4	53.4	9,078	
日本甜菜製糖	5.3	4.7	9,588	
三井製糖	5.5	5.9	13,688	
日新製糖	3.8	3.4	6,864	
森永製菓	18.1	16.5	92,565	
中村屋	2.5	2.5	11,175	
江崎グリコ	21.5	21	106,890	
名糖産業	5.4	4.9	6,443	
井村屋グループ	3.5	3.8	7,820	
不二家	4.5	4.3	9,520	
山崎製パン	58.5	53.3	108,518	
モロゾフ	1.6	1.7	8,449	
亀田製菓	4.5	4	20,120	
寿スピリッツ	7.5	6.7	51,322	
カルビー	32.7	32.2	114,632	
森永乳業	14.5	13.3	61,645	
六甲バター	5.5	5.3	9,582	
ヤクルト本社	53	48.5	316,705	
明治ホールディングス	50.5	46.5	350,145	
雪印メグミルク	17.3	17.1	45,588	
プリマハム	9.9	10.7	27,327	
日本ハム	30.7	26.9	125,085	
丸大食品	8	7	16,387	
S Foods	6.4	5.4	16,227	
伊藤ハム米久ホールディングス	40.6	45.3	32,525	
サッポロホールディングス	26.3	24.4	65,367	
アサヒグループホールディングス	150.1	148	779,368	
キリンホールディングス	324.1	299.6	731,473	
宝ホールディングス	53.9	53.7	57,673	
オエノンホールディングス	24.8	22.2	8,991	

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
養命酒製造	3.2	3.5	7,000	
コカ・コーラ ボトラスジャパンホールデ	54.7	49.8	131,770	
サントリー食品インターナショナル	47.5	47	223,485	
ダイドーグループホールディングス	3.9	3.5	16,222	
伊藤園	23.7	21.3	118,002	
キーコーヒー	6.9	6.7	16,073	
日清オイリオグループ	9	8.8	34,496	
不二製油グループ本社	17.5	17.3	53,197	
かどや製油	1	1.3	4,959	
J-オイルミルズ	3.6	3.6	15,714	
キッコーマン	47.1	50.6	283,360	
味の素	158.3	157.2	288,619	
キュービー	39.9	39.4	96,766	
ハウス食品グループ本社	27.1	26.3	100,992	
カゴメ	28.6	27.1	72,844	
焼津水産化学工業	7.7	5.7	5,996	
アリアケジャパン	6.4	6.4	50,432	
ニチレイ	37.1	33.6	86,721	
東洋水産	36.6	36.1	171,294	
イトアンド	3.6	3.7	6,604	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	—	4.4	5,310	
日清食品ホールディングス	30.2	29.9	246,077	
永谷園ホールディングス	4.6	4.2	9,038	
一正蒲鉾	3.3	4.3	4,570	
フジッコ	7.8	7.6	15,283	
ロック・フィールド	7.6	7.8	11,544	
日本たばこ産業	413.6	407.7	1,025,977	
ケンコーマヨネーズ	4.5	4.4	11,448	
わらべや日洋ホールディングス	5.1	5.1	9,276	
なとり	5.5	5.4	9,180	
ビックルスコーポレーション	2.3	2	5,570	
北の達人コーポレーション	28.9	23.6	16,614	
ユーグレナ	29.4	29.1	24,327	
ミヨシ油脂	3.5	4.3	5,551	
理研ビタミン	3.6	3	12,195	
<b>繊維製品 (0.6%)</b>				
片倉工業	10	11.1	15,295	
グンゼ	5.1	5.1	26,520	
東洋紡	30.3	28.2	45,740	
ユニチカ	21.3	23.7	8,911	
富士紡ホールディングス	3.9	3.9	13,572	
倉敷紡績	6.7	7.1	18,332	
シキボウ	6.3	—	—	
日本毛織	23	22.5	24,187	
ダイドーリミテッド	23	15	4,200	
帝国繊維	8	8.3	16,948	
帝人	56.7	55.3	115,908	
東レ	543.1	500.4	369,295	
住江織物	2.4	2.6	7,415	
アuzzi	8.1	9.6	7,958	
ダイニック	6.2	6.4	4,915	
セーレン	17.1	16.9	26,364	
小松マテーレ	12.5	12.8	10,624	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
ワコールホールディングス	20.5	18.2	56,147	
ホギメディカル	8.8	8	28,880	
レナウン	—	35	4,025	
T S Iホールディングス	25.8	24.5	13,548	
マツオカコーポレーション	2.5	2.8	6,151	
ワールド	8	10	27,660	
三陽商会	4.9	5.1	7,175	
オンワードホールディングス	45.4	41.7	26,813	
ゴールドウイン	6.3	12.6	100,044	
デサント	17	13.9	25,159	
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>				
特種東海製紙	4.5	4.4	17,842	
王子ホールディングス	311.9	285.3	180,309	
日本製紙	33.3	30.7	59,404	
三菱製紙	14.8	11.7	5,943	
北越コーポレーション	45.8	45.7	26,003	
中越パルプ工業	4	4.3	7,077	
巴川製紙所	3.1	—	—	
大玉製紙	33.1	29.4	43,923	
レンゴー	72.1	65.3	53,937	
トーモク	5.2	5.1	9,078	
ザ・バック	5.4	5	19,550	
<b>化学 (7.2%)</b>				
クラレ	117	108	145,584	
旭化成	497.5	459.4	562,535	
昭和電工	46.5	48.7	144,395	
住友化学	546.5	507.3	255,171	
住友精化	3.4	3.3	11,517	
日産化学	42.8	38.5	170,940	
ラサ工業	3.4	3.3	5,029	
クレハ	6.3	5.8	37,990	
多木化学	1.1	2.3	10,465	
テイカ	5.9	5.2	10,160	
石原産業	13.9	12.9	15,273	
日本曹達	10.9	10.2	30,151	
東ソー	107.7	105.2	174,526	
トクヤマ	20.4	19.9	59,222	
セントラル硝子	15.8	14.5	39,106	
東亞合成	44.3	43.6	55,590	
大阪ソーダ	7.5	6.9	21,045	
関東電化工業	16.9	16.8	17,690	
デンカ	27.4	24.9	82,045	
信越化学工業	123.2	118.4	1,409,552	
日本カーバイド工業	3.2	3.2	4,758	
堺化学工業	4.8	4.6	11,564	
第一稀元素化学工業	6.7	9.4	8,206	
エア・ウォーター	56.5	55.7	97,586	
大陽日酸	57.6	66.2	162,190	
日本化学工業	2.6	2.4	7,656	
日本パーカライジング	38.9	35.4	41,311	
高圧ガス工業	12.8	12.4	9,957	
チタン工業	—	1.8	4,820	
四国化成工業	11.8	10.4	13,457	

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	
戸田工業	2.1		2.5		5,535
ステラ ケミファ	4.3		4		12,940
保土谷化学工業	2.9		2.8		10,920
日本触媒	11.7		10.8		74,196
大日精化学工業	5.7		6.2		20,026
カネカ	18.4		17.7		63,100
三菱瓦斯化学	71.8		64.5		111,198
三井化学	63		62.6		165,890
J S R	70.2		64.3		124,099
東京応化工業	12.2		12		48,900
大阪有機化学工業	7.2		7.2		10,072
三菱ケミカルホールディングス	467		461		377,328
K H ネオケム	10.8		12.3		30,922
ダイセル	108.4		94		102,460
住友ベークライト	12.2		10.9		47,415
積水化学工業	151.5		148.2		284,544
日本ゼオン	63.2		62.3		87,531
アイカ工業	21.1		20.7		72,864
宇部興産	35.2		34.2		82,216
積水樹脂	11.5		12.3		28,117
タキロンシーアイ	16.9		16.1		10,883
旭有機材	5.3		4.5		7,740
日立化成	32.2		31.9		128,078
ニチバン	4.1		4.1		7,978
リケンテクノス	21.8		19.2		9,792
大倉工業	4.4		3.9		7,585
積水化成成品工業	11.3		10.2		8,160
群栄化学工業	2.4		2.4		5,997
ミライアル	—		3.3		4,544
ダイキョーニシカワ	14.6		14.4		12,441
森六ホールディングス	4.1		4.1		9,753
日本化薬	44.4		43.1		59,822
カーリットホールディングス	9.1		9.5		5,985
日本精化	7.3		6.7		8,361
扶桑化学工業	7.1		6.9		21,217
トリケミカル研究所	1.7		1.6		12,480
A D E K A	34.6		31.9		53,273
日油	27		25.9		96,607
ハリマ化成グループ	7.3		6.2		7,712
花王	173.3		168.5		1,467,298
第一工業製薬	3		2.9		10,802
石原ケミカル	2.8		—		—
三洋化成工業	4.6		4		21,960
大日本塗料	9.3		9.1		10,610
日本ペイントホールディングス	57.6		56.8		333,984
関西ペイント	78.6		77.6		217,047
中国塗料	23.2		20.3		20,990
日本特殊塗料	5.6		5.9		8,118
藤倉化成	12.6		13.2		7,550
太陽ホールディングス	5.7		5		20,875
D I C	31.6		28.7		86,042
サカタインクス	15.2		15.1		18,074
東洋インキS Cホールディングス	14.1		13.9		37,265

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株	数	株	数	
T & K T O K A	6.4		7.1		7,114
富士フイルムホールディングス	148.2		134.8		698,533
資生堂	141.9		139.8		1,121,056
ライオン	99.5		91.3		201,225
高砂香料工業	5		4.6		11,877
マンダム	15.8		15.8		47,953
ミルボン	8.9		9.4		59,314
ファンケル	31.6		28.6		83,912
コーセー	12.1		13.2		232,716
コタ	4.4		5.1		7,073
シーズ・ホールディングス	8.7		—		—
ポーラ・オルビスホールディングス	30.5		30		81,660
ノエビアホールディングス	4.4		6.6		41,448
エステー	5.6		5.4		9,374
アグロ カネショウ	3.3		3.3		4,735
コニシ	12.5		11.8		17,546
長谷川香料	8.7		9.7		19,225
星光P M C	6		—		—
小林製薬	20		19.7		178,088
荒川化学工業	7.1		7		11,067
メック	5.6		5.4		8,775
日本高純度化学	3.2		—		—
タカラバイオ	18.6		18.7		40,279
J C U	9.4		8.7		25,682
デクセリアルズ	18.8		19		20,805
アース製薬	5.3		5.3		30,210
北興化学工業	10.5		9.1		5,350
大成ラミック	3.6		3.3		9,405
クミアイ化学工業	29.7		29.5		30,296
日本農薬	18.6		14.6		8,584
アキレス	5.8		5.6		10,225
有沢製作所	12.8		11.7		11,676
日東電工	54		48.2		299,322
レック	7.8		8.1		10,530
三光合成	—		11.6		5,011
藤森工業	6.2		6.1		21,533
前澤化成工業	7.7		6.6		7,900
未来工業	—		4.5		10,093
J S P	4.5		4.6		8,763
エフビコ	5.8		7.8		51,870
天馬	5.4		5.3		10,663
信越ポリマー	13.7		12.6		12,196
東リ	23.5		23.1		7,299
ニフコ	28.6		25.5		77,775
バルカー	6.1		5.9		15,481
ユニ・チャーム	151.6		136.1		494,587
医薬品 (6.0%)					
協和キリン	88.7		70.2		164,338
武田薬品工業	281.9		586		2,631,726
アステラス製薬	658		619.5		1,175,811
大日本住友製薬	52.9		52.5		111,457
塩野義製薬	93.4		89.9		585,878
田辺三菱製薬	73.9		85.2		170,655

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
あすか製薬	9.4	9	11,898	
日本新薬	18.7	18.4	183,264	
中外製薬	74.1	73.4	720,274	
科研製薬	13	12.2	72,834	
エーザイ	85.5	84.3	680,469	
ロート製薬	36.7	35.9	125,829	
小野薬品工業	168.9	162	398,115	
久光製薬	21.1	20.7	111,987	
持田製薬	5.5	10	44,750	
参天製薬	135.2	130.9	270,177	
扶桑薬品工業	3.8	3.6	7,570	
日本ケミファ	1.6	1.5	4,458	
ツムラ	22.3	22.1	70,609	
日医工	17.1	20.1	27,135	
キッセイ薬品工業	12.8	12.8	39,040	
生化学工業	14	14.2	18,048	
栄研化学	12.6	12.8	25,446	
鳥居薬品	4.1	4.5	12,829	
JCRファーマ	5.1	5	46,750	
東和薬品	3.4	9	25,551	
富士製薬工業	5.3	5.6	7,896	
沢井製薬	14.8	14.7	95,991	
ゼリア新薬工業	14.2	13	28,314	
第一三共	204.3	201.4	1,412,216	
キョーリン製薬ホールディングス	18.3	14.7	27,621	
大幸薬品	4.1	3.3	11,121	
ダイト	4.3	4.4	13,970	
大塚ホールディングス	136	134.1	648,909	
大正製薬ホールディングス	15.9	14.8	121,064	
ペプチドリーム	33.1	35.7	182,427	
<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>				
日本コークス工業	75	81.7	6,617	
昭和シェル石油	66.9	—	—	
ニチレキ	10.1	9.5	12,350	
ユシロ化学工業	5.1	5.9	8,112	
富士石油	19.7	25.2	5,997	
MORESCO	3.8	—	—	
出光興産	55.2	79.1	234,610	
JXTGホールディングス	1,215.3	1,090.7	531,825	
コスエネルギーホールディングス	20.2	20.7	49,555	
<b>ゴム製品 (0.8%)</b>				
横浜ゴム	41.6	40.7	93,732	
TOYO TIRE	37.3	41.2	65,096	
ブリヂストン	219.5	216.7	958,030	
住友ゴム工業	64.3	63.4	89,520	
オカモト	5.1	4.5	18,810	
ニッタ	8	7.9	25,240	
住友理工	14.1	13.7	14,015	
三ツ星ベルト	9.6	9.6	20,265	
バンドー化学	14.2	13.5	12,501	
<b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b>				
日東紡績	10.6	10.6	43,460	
AGC	71.5	69.5	283,212	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
日本板硝子	33.5	21.5	13,953	
日本山村硝子	4.2	5.4	6,928	
日本電気硝子	30.9	28.5	67,830	
オハラ	3.1	3.6	5,259	
住友大阪セメント	14.6	13.7	64,253	
太平洋セメント	45	44.5	144,180	
日本ヒューム	8.9	9.3	7,635	
日本コンクリート工業	20.5	20.5	5,576	
三谷セキサン	3.7	3.5	12,565	
アジアパイルホールディングス	11.7	13.3	7,315	
東海カーボン	64.7	73.8	80,368	
日本カーボン	3.5	3.7	15,854	
東洋炭素	4.4	4.6	11,164	
ノリタケカンパニーリミテド	4.3	4	19,040	
TOYO	54.7	50.3	240,685	
日本碍子	86.5	85.4	158,587	
日本特殊陶業	60	54.6	121,648	
MARUWA	2.6	2.8	21,140	
品川リフラクトリーズ	2.2	2.4	7,728	
黒崎播磨	1.5	1.5	8,730	
ヨータイ	7.8	8.2	5,690	
東京窯業	12.6	16.5	5,626	
ニッカトー	4.3	—	—	
フジミインコーポレーテッド	6.4	6.4	18,489	
ニチアス	19.3	19.3	50,392	
ニチハ	9.9	9.7	26,936	
<b>鉄鋼 (0.8%)</b>				
日本製鉄	316	311.5	507,277	
神戸製鋼所	129.4	129.3	73,571	
中山製鋼所	11.9	13	6,461	
合同製鐵	4.1	4.1	10,799	
ジェイエフイーホールディングス	190.7	187.9	265,314	
日新製鋼	17.2	—	—	
東京製鐵	37.7	34.2	28,591	
共英製鋼	8	8	16,800	
大和工業	15.2	15.1	41,600	
東京製鋼	4.1	4	6,128	
大阪製鐵	5.1	4.5	6,520	
淀川製鋼所	9.2	9.1	19,373	
丸一鋼管	25.1	22.9	72,822	
モリ工業	2.7	2.7	6,760	
大同特殊鋼	11.8	11.4	56,601	
日本冶金工業	61.4	5.9	13,747	
山陽特殊製鋼	8.9	5.4	8,083	
愛知製鋼	3.9	3.9	14,196	
日立金属	77.7	74.9	115,121	
大平洋金属	5	4.9	11,848	
新日本電工	46.4	50.2	9,086	
栗本鐵工所	4.6	4.3	8,518	
三菱製鋼	6	6.7	7,638	
シンニッタン	14.7	14.7	6,556	
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	13.1	11.2	8,769	

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
日本軽金属ホールディングス	196.2	178	40,406	
三井金属鉱業	19.4	18.9	52,182	
東邦亜鉛	4	4	8,540	
三菱マテリアル	46.6	45.7	134,906	
住友金属鉱山	97	89.2	294,449	
DOWAホールディングス	16.6	17.6	69,520	
古河機械金属	11.8	12.5	18,950	
大阪チタニウムテクノロジーズ	8.6	7.8	12,269	
東邦チタニウム	13.2	13.7	13,289	
UACJ	10.5	10.7	26,610	
CKサンエツ	1.7	1.8	5,409	
古河電気工業	20.6	21.5	65,145	
住友電気工業	264.2	260	435,370	
フジクラ	87.2	85.9	39,428	
昭和電線ホールディングス	—	9.6	9,744	
タツタ電線	16.3	15.3	8,981	
平河ヒューテック	3.6	—	—	
リョービ	8.8	8.5	17,875	
アーレスティ	10.2	11.5	6,141	
アサヒホールディングス	13.4	12.5	32,587	
<b>金属製品 (0.6%)</b>				
稲葉製作所	5.7	5.5	7,870	
宮地エンジニアリンググループ	2.7	3.3	6,880	
トーカロ	19.6	19.4	21,572	
アルファCo	4	4.3	5,637	
SUMCO	78.5	83.5	141,198	
川田テクノロジーズ	1.7	1.7	11,645	
RS Technologies	1.6	2.2	8,173	
東洋製罐グループホールディングス	44.9	44.6	86,613	
ホッカンホールディングス	4.8	4.8	9,408	
コロナ	5.6	5.9	7,021	
横河ブリッジホールディングス	13.3	13	24,583	
三和ホールディングス	73.2	66.8	81,496	
文化シャッター	21.5	21.2	20,585	
三協立山	10.2	10.5	13,104	
アルインコ	8.9	7	8,379	
LIXILグループ	104.2	103	194,155	
ノーリツ	15.7	14.9	20,979	
長府製作所	7	7.2	17,719	
リンナイ	12.6	13.6	114,648	
日東精工	12.5	13	8,502	
岡部	15.2	14.6	13,519	
ジーテクト	8.3	8.7	15,103	
東ブレ	12.8	12.9	22,304	
高周波熱錬	14.4	14.2	12,595	
東京製綱	5.9	6.7	7,745	
パイオラックス	11.2	10.2	22,603	
エイチワン	8	9.3	7,858	
日本発條	71	75	73,650	
三益半導体工業	6.1	6.2	12,474	
<b>機械 (5.1%)</b>				
日本製鋼所	21.8	21.5	48,697	
三浦工業	30.7	30.1	111,219	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
タクマ	25.7	23.7	30,288	
ツガミ	16.1	14.8	16,738	
オークマ	9	8	49,200	
東芝機械	8	7.9	22,127	
アマダホールディングス	107.8	87.3	108,863	
アイダエンジニアリング	19.5	18.2	18,236	
FUJII	20.6	28.7	55,878	
牧野フライス製作所	8.1	8	43,280	
オーエスジー	35	32.4	73,126	
旭ダイヤモンド工業	19.2	19.1	12,529	
DMG森精機	44.9	43.9	76,956	
ソディック	15.6	16.7	17,067	
ディスコ	9.6	9.4	221,370	
日東工器	4.4	4.3	9,576	
日進工具	2.4	2.1	4,882	
パンチ工業	—	9.2	5,280	
豊和工業	5	5.7	4,263	
津田駒工業	2.2	—	—	
島精機製作所	9.8	11.3	31,402	
オプトラン	7.1	8	23,464	
イワキポンプ	—	4.5	5,157	
フリー	7.6	8.6	9,030	
ヤマシンフィルタ	12.9	15.2	13,315	
日阪製作所	10.1	10.3	10,300	
やまびこ	13.7	13.8	15,745	
平田機工	3.4	3.3	26,301	
ベガサスミシン製造	8.6	10.7	5,489	
マルマエ	—	3.5	3,650	
タツモ	—	3.6	4,312	
ナプテスコ	39	40.9	139,469	
三井海洋開発	7.5	7.6	18,977	
レオン自動機	7.1	6.9	11,433	
S MC	20.9	22.1	1,103,453	
ホソカワミクロン	2.6	2.7	12,190	
ユニオンツール	3.2	2.6	8,554	
オイレス工業	9.8	9.3	15,735	
日精エー・エス・ビー機械	2.3	2.6	12,727	
サトーホールディングス	8.6	10.1	34,037	
技研製作所	4.9	6.4	28,416	
日精樹脂工業	7.3	7.3	7,489	
オカダアイオン	3.2	—	—	
ワイエイシイホールディングス	—	4.1	2,931	
小松製作所	323.3	318.7	824,476	
住友重機械工業	40.5	39.8	125,967	
日立建機	28.5	27.5	81,152	
日工	2.7	12.4	9,312	
巴工業	3.7	3.9	8,899	
井関農機	7.5	7.9	13,090	
TOWA	7.3	7.8	8,970	
北川鉄工所	3.7	3.6	8,164	
ローツェ	3.6	3.2	12,560	
クボタ	382.8	373.2	643,956	
荏原実業	3.5	2.6	5,891	

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	
三菱化工機	3.9		3.7		7,052
月島機械	14.2		13.4		22,860
帝国電機製作所	5.8		7.1		9,386
新東工業	17		16.7		17,334
澁谷工業	6.3		6.3		19,908
アイチ コーポレーション	14.2		13.7		9,905
小森コーポレーション	19.1		17.6		20,433
鶴見製作所	6		6.1		12,541
住友精密工業	1.8		1.8		6,210
酒井重工業	1.8		1.9		5,823
荏原製作所	31.8		29.3		98,008
西島製作所	9.8		8.9		8,561
北越工業	8.1		8.5		10,863
ダイキン工業	97.4		89.7		1,414,569
オルガノ	3.1		2.6		17,004
トーヨーカネツ	3.1		3.9		8,907
栗田工業	38.5		37.8		118,503
椿本チエイン	9.1		9.6		36,672
大同工業	5.7		6.2		5,189
アネスト岩田	11.8		11.9		12,090
ダイフク	39.3		35.6		234,604
加藤製作所	3.9		4.5		8,284
タダノ	35		34.8		37,966
フジテック	25.5		25.1		43,799
CKD	19.9		19.7		36,543
キトー	6.1		6		9,906
平和	19.7		19.7		44,699
理想科学工業	6.2		6.6		12,493
SANKYO	17.9		16.1		59,892
日本金銭機械	9		9.4		8,732
マースグループホールディングス	5.1		5.5		11,198
福島工業	4.3		4.4		15,400
ダイコク電機	4.3		4.5		7,569
竹内製作所	11.9		11.6		19,627
アマノ	20.7		18.5		60,772
JUKI	10.2		10.6		9,688
サンデンホールディングス	9.3		—		—
蛇の目マシン工業	9.9		—		—
マックス	10.9		10.7		22,534
グローリー	19.9		19.7		65,601
新晃工業	7.4		6.9		13,047
大和冷機工業	10.3		10.7		13,824
セガサミーホールディングス	71		70.4		111,584
日本ピストンリング	3.5		4.4		6,340
リケン	3.3		3.4		14,603
TPR	9.4		9		18,819
ツバキ・ナカシマ	11		14.6		25,053
ホシザキ	20.8		20.6		197,966
大豊工業	6.9		7.4		6,467
日本精工	145		130.7		140,763
NTN	152.2		161.9		56,017
ジェイテクト	67.6		65.9		91,205
不二越	6.8		6.6		33,924

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株数	株数	株数	株数	
日本トムソン	22.3		22.9		11,427
THK	44.7		40.8		127,296
ユーシン精機	6.3		6.7		7,095
前澤給装工業	4.1		3.7		7,943
イーグル工業	9.3		8.9		9,665
日本ピラー工業	8.3		7.8		11,793
キッツ	28.9		29		22,098
マキタ	86.6		91.5		339,007
日立造船	54.2		56		24,360
三菱重工業	119.7		117.7		499,518
IHI	54.8		50.9		131,525
スター精密	12.5		11.2		17,348
電気機器 (14.2%)					
日清紡ホールディングス	39.6		47.8		48,708
イビデン	44.1		43.5		112,186
コニカミノルタ	156.2		155.1		112,602
ブラザー工業	92.7		85.5		188,185
ミネベアミツミ	132.3		130.1		280,885
日立製作所	321.1		338.3		1,457,734
三菱電機	713.2		704		1,080,288
富士電機	46.3		42.2		144,535
東洋電機製造	4		3.8		5,947
安川電機	82.8		75.6		307,314
シンフォニアテクノロジー	10.3		9.4		12,943
明電舎	14.2		13.1		28,138
オリジン	3.2		3.4		5,157
山洋電気	3.6		3.5		19,110
デンヨー	7.5		6.5		13,585
東芝テック	8.8		8.8		39,248
芝浦メカトロニクス	1.7		1.6		6,352
マブチモーター	19.6		19.3		81,542
日本電産	85.9		84.7		1,382,727
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4.2		—		—
トレックス・セミコンダクター	3.2		4.9		7,198
東光高岳	4.4		5.5		6,583
ダブル・スコープ	10.9		—		—
宮越ホールディングス	—		3.9		4,009
ダイヘン	7.9		7.7		28,451
ヤーマン	10.6		11.2		7,862
JVCケンウッド	53.2		60		16,500
ミマキエンジニアリング	7.3		9.3		4,910
第一精工	3.9		3		7,935
日新電機	17		16.7		19,238
大崎電気工業	15.9		16.2		12,069
オムロン	75.7		65.3		427,062
日東工業	11.6		10.7		26,792
I D E C	9.9		10.5		24,832
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26		24.1		55,526
サクサホールディングス	2.7		3		5,934
メルコホールディングス	3		2.8		8,680
日本電気	92		85.4		379,176
富士通	68.9		67.9		682,395
沖電気工業	31.4		29.9		45,747

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	
電気興業	4.3	3.7	11,525
サンケン電気	8.6	8	25,360
アイホン	5.4	5.1	9,720
ルネサスエレクトロニクス	73	336.3	241,799
セイコーエプソン	88.4	86.9	144,427
ワコム	53	47.8	21,414
アルバック	16.6	14.1	60,630
EIZO	6.6	5.5	22,990
ジャパンディスプレイ	93	—	—
日本信号	18.3	18.5	24,124
京三製作所	18.5	19	9,804
能美防災	9.5	9.6	22,876
ホーチキ	5.3	6	10,002
エレコム	6.5	7.7	31,916
パナソニック	815.1	805.2	830,966
シャープ	71.1	81.6	135,129
アンリツ	45.8	45.7	94,690
富士通ゼネラル	22.3	19.8	41,718
ソニー	478.4	444.9	3,113,410
TDK	37.3	33.8	395,122
帝国通信工業	5.4	5.8	6,989
タムラ製作所	28.1	24.2	15,972
アルプスアルパイン	65.3	62.2	154,691
日本トリム	1.6	1.3	6,448
ローランド ディー. ジー.	4.3	4.8	10,440
フォスター電機	8.8	7.7	15,577
クラリオン	6.2	—	—
SMK	2.6	2.4	7,149
ヨコオ	5.7	4.6	14,973
ホシデン	21.3	19.3	25,437
ヒロセ電機	10.3	10.9	149,439
日本航空電子工業	16.4	16	33,664
TOA	8.6	8.9	9,790
マクセルホールディングス	15.3	15.4	23,007
古野電気	9.7	10.1	12,756
ユニデンホールディングス	2.8	2.8	5,143
アルパイン	12.9	—	—
スミダコーポレーション	7	6.4	8,480
アイコム	4.4	4.6	11,904
リオン	3.8	3.5	10,374
本多通信工業	7.6	—	—
船井電機	10.7	9.5	7,030
横河電機	71.4	64.7	130,305
新電元工業	2.7	2.8	10,318
アズビル	46.2	44.1	140,458
東亜ディーケーケー	4.6	5.5	4,730
日本光電工業	31.6	29.6	87,882
チノー	4.5	4.2	5,972
共和電業	11.7	15.2	6,733
堀場製作所	14.3	14	102,900
アドバンテスト	49.1	52.4	278,768
エスベック	6.9	6.5	13,858
キーエンス	35	63.8	2,422,486

銘柄	期首(前期末)		期末
	株数	株数	
日置電機	3.9	3.9	14,586
シスメックス	55.6	50.5	391,930
日本マイクロニクス	12.9	11.5	13,271
メガチップス	6	7	17,234
OBARA GROUP	4.2	3.8	14,763
コーセル	10.9	9.9	12,384
イリソ電子工業	6.5	6	31,800
オプテックスグループ	12.8	11.9	19,301
千代田インテグレ	3.6	3.8	9,101
アイ・オー・データ機器	4.1	—	—
レーザーテック	14.7	14.4	137,952
スタンレー電気	50.5	49.3	153,076
岩崎電気	4.7	4.6	6,555
ウシオ電機	43.7	41.4	68,020
ヘリオス テクノ ホールディング	7.6	9.2	4,600
日本セラミック	7.4	7.4	21,171
古河電池	6.8	—	—
山一電機	5.8	5.7	9,091
図研	5.4	5.1	12,801
日本電子	14.3	14	43,260
カシオ計算機	63.2	62.6	130,208
ファナック	67.8	66.9	1,420,956
日本シイエムケイ	19.4	17.8	11,712
エンプラス	3.6	3.6	13,140
ローム	34.5	31.2	286,104
浜松ホトニクス	51.1	50.4	224,532
三井ハイテック	8.5	8	16,408
新光電気工業	23.7	23.6	25,865
京セラ	108.8	99.1	737,799
太陽誘電	32.1	31.3	93,117
村田製作所	74.9	206.8	1,350,197
ユージン	13.9	—	—
双葉電子工業	11.6	11.5	15,973
北陸電気工業	—	4.2	4,720
ニチコン	22.9	24.2	29,887
日本ケミコン	5.4	5.9	12,277
KOA	11.2	11	15,840
市光工業	11.3	11.2	9,721
小糸製作所	42.5	42.1	239,970
ミツバ	14	14	10,374
SCREENホールディングス	12.5	12.3	93,480
キャノン電子	6.5	7.5	15,562
キヤノン	384.4	378.8	1,153,824
リコー	214.3	179.1	201,308
象印マホービン	13.6	21.1	37,937
東京エレクトロン	47.6	46.9	1,058,533
輸送用機器 (7.8%)			
トヨタ紡織	24.9	20.2	34,865
ユニプレス	14.5	13.8	23,294
豊田自動織機	57.5	56.9	368,143
モリタホールディングス	12.5	12.5	21,950
三櫻工業	11.2	8.5	11,390
デンソー	158.2	155	767,715

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
東海理化電機製作所	19	18.4	39,799	
三井E&Sホールディングス	26.4	14.9	13,737	
川崎重工業	55.5	54.7	135,710	
名村造船所	23.5	27.4	7,863	
日本車輛製造	3.1	3.3	10,477	
三菱ロジスネクスト	9.2	9.2	11,279	
日産自動車	841.4	830.6	571,701	
いすゞ自動車	226.2	204.9	264,423	
トヨタ自動車	795.5	784.8	6,072,782	
日野自動車	88.9	87.7	96,645	
三菱自動車工業	263.9	261.1	129,505	
エフテック	6.7	7.6	5,738	
武蔵精密工業	16.8	15.9	24,215	
日産車体	14.8	14.2	16,159	
新明和工業	33	19.2	28,032	
極東開発工業	14.4	12.7	20,713	
日信工業	12.8	14.3	31,803	
トビー工業	6	6	12,504	
ティラド	3.3	3.5	7,122	
タチエス	12.3	12	17,304	
NOK	38.5	38.1	65,874	
フタバ産業	20.3	20.1	16,602	
KYB	7.6	8	26,520	
大同メタル工業	13.3	16.8	12,230	
プレス工業	35.9	35.7	15,850	
ミクニ	11.2	—	—	
太平洋工業	14.9	15	22,695	
ケーヒン	16.1	16	41,152	
河西工業	9.9	11	9,603	
アイシン精機	58.5	57.7	244,936	
マツダ	224.9	206.8	202,043	
今仙電機製作所	8.8	9.5	8,939	
本田技研工業	602	554.3	1,720,547	
スズキ	130.7	139.7	664,273	
SUBARU	221.6	218.9	629,009	
安永	3.9	4.1	5,301	
ヤマハ発動機	100.5	92	212,244	
ショーワ	16.9	16.6	37,798	
TBK	16.5	15.3	6,594	
エクセディ	9.2	9.4	23,575	
豊田合成	23.2	22.7	59,110	
愛三工業	12.9	12.3	10,651	
日本ブラスト	7.4	8.4	6,031	
ヨロズ	7.4	7.7	11,134	
エフ・シー・シー	12.7	11.3	27,255	
シマノ	28.7	26.3	471,296	
テイ・エス テック	16.8	16.4	56,006	
ジャムコ	3.9	4.8	7,248	
<b>精密機器 (2.3%)</b>				
テルモ	100.7	199.3	779,263	
日機装	23.2	21.6	29,116	
日本エム・ディ・エム	—	4.6	10,704	
島津製作所	91.4	84.3	279,454	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
JMS	12	9.6	7,132	
長野計器	7.4	7.8	6,107	
パイ・テクノロジ	1.7	3.3	19,833	
東京計器	6	6.4	6,496	
インターアクション	4.3	4.2	10,508	
東京精密	12.7	12.8	50,368	
マニ	8.8	28.3	83,060	
ニコン	123.9	113.6	171,081	
トプコン	38.6	36.1	53,103	
オリンパス	105.9	390	637,260	
理研計器	6.4	6.1	14,182	
タムロン	6.4	5.9	14,921	
HOYA	143.7	141.8	1,421,545	
シード	3.5	—	—	
ノーリツ鋼機	5.8	5.2	9,859	
エー・アンド・ディ	7.9	7.9	6,343	
朝日インテック	25.6	59.7	190,741	
シチズン時計	78.4	82.7	50,447	
リズム時計工業	3.5	—	—	
大研医器	8.5	—	—	
メニコン	9.9	9.6	41,760	
松風	3.2	4.3	7,310	
セイコーホールディングス	11.1	9.8	27,596	
ニプロ	49.9	49.9	66,217	
<b>その他製品 (2.3%)</b>				
スノーピーク	3.2	4.5	4,932	
パラマウントベッドホールディングス	8.1	7.3	31,463	
トランザクション	5.1	5.3	5,300	
ニホンフラッシュ	3.6	3.7	10,430	
前田工織	8.1	8.1	15,795	
永大産業	16.8	14.7	5,012	
アートネイチャー	10.7	8.2	6,338	
バンダイナムコホールディングス	73.7	73	488,224	
SHOEI	3.5	3.4	17,204	
フランスベッドホールディングス	12.8	11.8	12,059	
パイロットコーポレーション	12.6	12.5	53,375	
萩原工業	4.7	4.4	7,114	
トッパン・フォームズ	15.1	14.9	17,313	
フジシールインターナショナル	15.9	15.9	39,543	
タカラトミー	30.1	31.8	42,771	
廣済堂	12	7.6	6,688	
プロネクス	7.9	7.2	8,683	
大建工業	5.8	5	9,870	
凸版印刷	99.6	99.2	216,057	
大日本印刷	100	91.7	269,598	
図書印刷	8.1	—	—	
共同印刷	3.3	2	5,900	
NISSHA	14.9	14.8	16,768	
TAKARA & COMPANY	5.1	3.7	6,297	
アシックス	71	58.9	105,195	
小松ウオール工業	—	2.6	6,260	
ヤマハ	42.4	41.7	255,621	
河合楽器製作所	2.5	2.5	9,187	

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	
クリナップ	9.5		9		6,345
ビジョン	43.3		42.6		215,982
キングジム	8.8		6.8		6,065
リンテック	17.2		17		41,871
イトーキ	15.8		18.5		9,564
任天堂	44		43.2		1,867,968
三菱鉛筆	11.7		11.5		19,975
タカラスタンダード	14.3		14.1		28,298
コクヨ	34.4		34		55,590
ナカバヤシ	7.8		7.4		4,395
グロープライド	3.9		3.6		9,730
オカムラ	24.6		24.3		26,244
美津濃	7.1		6.5		18,232
<b>電気・ガス業（1.5%）</b>					
東京電力ホールディングス	568.1		558.3		269,658
中部電力	218.2		215.4		330,746
関西電力	291.2		267.2		334,267
中国電力	97.5		96.8		140,940
北陸電力	70.1		66		52,140
東北電力	166.5		176		194,480
四国電力	64.3		63.8		67,564
九州電力	145.8		143.7		139,532
北海道電力	67.5		68.1		36,229
沖縄電力	13.1		13		26,039
電源開発	56.5		55.7		149,164
エフオン	5.2		—		—
イーレックス	12.9		10.4		18,168
レノバ	7.7		11.5		13,340
東京瓦斯	140.2		136		360,808
大阪瓦斯	139.1		136.7		283,925
東邦瓦斯	35.2		34.9		145,533
北海道瓦斯	5		4.6		7,295
広島ガス	20.5		17		6,103
西部瓦斯	8.1		7.8		19,656
静岡ガス	21.7		20.4		18,931
メタウォーター	3.8		3.2		13,024
<b>陸運業（4.5%）</b>					
SBSホールディングス	7.8		6.6		12,982
東武鉄道	74.8		73.9		299,664
相鉄ホールディングス	24.5		22.8		69,312
東急	193.5		177.4		386,199
京浜急行電鉄	97.9		90.4		202,676
小田急電鉄	113.6		104		281,632
京王電鉄	39.6		36.5		257,690
京成電鉄	53.3		48.8		221,308
富士急行	9.8		9.8		41,797
新京成電鉄	3.4		2.8		6,448
東日本旅客鉄道	126.9		124		1,250,540
西日本旅客鉄道	64.2		62.8		607,590
東海旅客鉄道	63.9		58.5		1,301,332
西武ホールディングス	91		94.6		182,578
鴻池運輸	11.2		10.6		17,627
西日本鉄道	20		20		52,580

銘柄	期首(前期末)		期		末 評価額
	株	数	株	数	
ハマキョウレックス	5.5		5.5		20,157
サカイ引越センター	3.8		3.7		25,789
近鉄グループホールディングス	67.2		66.6		409,590
阪急阪神ホールディングス	90		88.9		421,830
南海電気鉄道	30.4		32.1		97,584
京阪ホールディングス	29.9		29.6		161,320
神戸電鉄	2.7		1.7		6,783
名古屋鉄道	53.7		54.5		190,477
山陽電気鉄道	5.6		5.9		13,263
日本通運	26.4		23.5		164,735
ヤマトホールディングス	118.8		117.1		222,607
山九	18.8		18.5		105,265
丸全昭和運輸	5.5		5.7		17,727
センコーグループホールディングス	37.2		35.9		32,920
トナミホールディングス	1.8		1.8		9,216
ニッコンホールディングス	25.9		23.8		64,974
福山通運	8.6		8.4		35,154
セイノーホールディングス	50.8		49.7		73,506
神奈川中央交通	2.5		2.3		9,234
日立物流	14.3		11.8		36,698
丸和運輸機関	3.6		6.9		17,733
C&Fロジホールディングス	8.6		7.6		10,700
九州旅客鉄道	56.8		59.6		225,288
S Gホールディングス	63.9		70		184,310
<b>海運業（0.2%）</b>					
日本郵船	56		55.4		106,645
商船三井	39.9		41.9		123,269
川崎汽船	21.2		19.8		37,204
N Sユナイテッド海運	4.1		4.4		10,203
飯野海運	33.8		38.2		13,752
乾汽船	8		5.8		6,658
<b>空運業（0.5%）</b>					
日本航空	124.1		122.3		414,719
A N Aホールディングス	124.1		122.2		459,227
<b>倉庫・運輸関連業（0.2%）</b>					
トランコム	1.9		2		15,600
日新	6		6.3		10,980
三菱倉庫	23.4		21.3		60,385
三井倉庫ホールディングス	8.6		8.1		16,191
住友倉庫	26.1		24		36,240
澁澤倉庫	5.5		4.6		9,885
東陽倉庫	25.3		20.9		7,022
日本トランスシティ	19.5		17.3		9,480
川西倉庫	2.6		3.2		3,372
安田倉庫	8.7		7.5		7,462
東洋埠頭	2.4		4.9		6,918
上組	42.2		38.6		94,338
キューソー流通システム	2.3		—		—
近鉄エクスプレス	12.6		14		27,216
エアイティー	5.4		6.4		6,195
日本コンセプト	—		3.6		5,148
<b>情報・通信業（8.5%）</b>					
N E C ネットエスアイ	7.6		6.5		22,392

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
システナ	25.3	24.4	42,846	
デジタルアーツ	3.9	3.5	22,120	
日鉄ソリューションズ	10.4	10.2	38,862	
キューブシステム	6.1	6.8	5,426	
コア	4.4	3.9	5,635	
ソリトンシステムズ	5.3	4.7	5,165	
ソフトクリエイトホールディングス	4.4	4	7,136	
T I S	23.4	23	152,030	
ネオス	2.9	—	—	
電算システム	3.9	3.3	9,850	
グリー	38	49.7	25,993	
コーエーテックモホールディングス	14.4	14.1	37,844	
三菱総合研究所	3	3.3	13,827	
ファインデックス	8.1	7.6	9,074	
ブレインパッド	1.6	1.5	8,625	
K L a b	13	14	11,900	
ホールトゥウィン・ビットクルーホールディ	4.9	9.5	10,203	
イーブックイニシアティブジャパン	1.5	—	—	
ネクソン	178.6	196.8	295,396	
アイスタイル	18.4	18.7	15,128	
エムアップ	2.7	2.5	6,462	
エイチーム	4.9	6.7	7,624	
エジモ	—	6.5	6,870	
テクノスジャパン	6.9	—	—	
コロブラ	20.8	23.2	29,533	
ブロードリーフ	36.3	36.1	25,594	
デジタルハーツホールディングス	4.3	5.4	5,518	
システム情報	—	4.3	4,790	
メディアドゥホールディングス	2.4	2.5	9,400	
じげん	9.3	19.6	10,858	
フィックスターズ	7.3	8	13,024	
CARTA HOLDINGS	4.8	4.5	6,129	
オブティム	1.8	2.4	8,364	
セレス	2.8	3.2	3,900	
S H I F T	—	1.8	14,364	
ティーガイア	6.9	6.1	15,975	
セック	1.4	1.5	5,827	
豆蔵ホールディングス	7.1	5.4	7,792	
テクマトリックス	5.4	5	11,625	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	174.5	17.3	41,468	
GMOペイメントゲートウェイ	11.6	11.5	90,965	
システムリサーチ	1.2	2.6	4,755	
インターネットイニシアティブ	11.6	10.6	27,061	
さくらインターネット	10.5	8.4	5,577	
ヴィンクス	2.7	—	—	
GMOクラウド	2	1.8	5,250	
S R Aホールディングス	4.1	4.4	11,202	
e B A S E	2.9	4.8	5,745	
アバント	—	5.8	6,008	
アドソル日進	2.9	2.8	6,678	
フリービット	5.8	5.5	5,131	
コムチュア	4.2	7.9	18,975	
アステリア	4.4	5.7	3,687	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
マークライnz	3.3	4.3	8,987	
メディカル・データ・ビジョン	6.6	6.1	6,002	
g u m i	9.1	10.2	7,354	
モバイルファクトリー	2.5	2.3	3,210	
テラスカイ	—	3	8,553	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	3.6	3.9	6,606	
P C Iホールディングス	1.7	—	—	
ダブルスタンダード	—	1.1	6,050	
オープンドア	3.8	4	7,136	
アカツキ	2.6	2.6	16,692	
U b i c o mホールディングス	—	2.3	2,895	
L I N E	21.6	16.1	82,754	
チェンジ	—	1.8	4,528	
オークネット	5.2	5.8	7,801	
A O I T Y O Holdings	8.3	8.7	6,011	
マクロミル	9.2	13.6	13,940	
オロ	0.9	2.2	9,449	
サインポスト	—	1.5	2,749	
ソルクシーズ	—	4.4	4,184	
フェイス	4.5	—	—	
プロトコーポレーション	—	7.5	7,807	
野村総合研究所	44.5	115.1	265,765	
サイバネットシステム	7.6	6.5	5,096	
インテージホールディングス	10.7	10.7	10,314	
ソースネクスト	28.2	34.8	17,086	
インフォコム	—	7.7	19,003	
ラクスル	—	3.9	14,293	
アルテリア・ネットワークス	—	8.5	13,829	
フォーカスシステムズ	6	6.2	5,592	
クレスコ	2.4	2.5	8,950	
フジ・メディア・ホールディングス	73	67.1	100,448	
オービック	24.3	23.9	349,179	
ジャストシステム	10.1	11.2	63,392	
T D Cソフト	7.1	7.2	6,472	
Zホールディングス	457.5	949.7	363,735	
トレンドマイクロ	37.4	30.9	185,400	
I Dホールディングス	—	3.9	5,616	
日本オラクル	11.4	13.9	139,417	
アルファシステムズ	2.9	2.7	7,570	
フューチャー	10.1	8.7	16,051	
C A C Holdings	7.7	5.9	9,274	
S Bテクノロジ	3.2	3	5,973	
オービックビジネスコンサルティング	3.6	7	34,230	
伊藤忠テクノソリューションズ	32	31.4	92,661	
アイティフォー	9.9	10.3	9,053	
大塚商会	37.9	37.2	164,424	
サイボウズ	10.2	9.7	11,620	
ソフトブレーン	—	5.5	3,118	
電通国際情報サービス	4.5	4.3	18,081	
デジタルガレージ	13.9	12.7	52,514	
E Mシステムズ	7.2	5.3	10,907	
ウェザーニューズ	3	3	10,320	
C I J	9	8.2	8,241	

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
WOWOW	3.6	3.5	9,453	
スカラ	7.4	6.4	5,036	
IMAGICA GROUP	7.4	7.8	5,023	
ネットワンシステムズ	24.9	26.5	83,475	
アルゴグラフィックス	3.1	6	20,010	
マーベラス	12.2	13.1	9,929	
エイベックス	12.3	12.6	16,808	
日本ユニシス	21.8	21.7	78,011	
兼松エレクトロニクス	3.9	3.8	13,015	
東京放送ホールディングス	46.7	42.3	74,025	
日本テレビホールディングス	64.4	58.3	84,651	
朝日放送グループホールディングス	10.5	10.8	8,089	
テレビ朝日ホールディングス	19.6	19.7	34,849	
スカパーJ SATホールディングス	53.4	47	21,808	
テレビ東京ホールディングス	5.8	6	13,818	
ビジョン	2.3	6.7	12,013	
コネクシオ	5.5	4.8	7,320	
日本電信電話	479.1	461.8	2,585,156	
KDDI	617.2	514.8	1,621,620	
ソフトバンク	—	627.4	930,747	
光通信	8.3	7.1	183,748	
NTTドコモ	503	510.1	1,533,870	
エムティーアイ	10.2	9.1	6,297	
GMOインターネット	25.9	27.5	62,397	
KADOKAWA	20.6	19.1	33,921	
学研ホールディングス	2.5	2.5	18,725	
ゼンリン	14.1	14	26,698	
アイネット	5.2	4.7	7,167	
松竹	4.8	4.6	74,658	
東宝	46.1	41.5	185,297	
東映	2.9	2.6	44,642	
エヌ・ティ・ティ・データ	186.5	182.8	277,490	
ビブ・シー・エー	—	1.3	5,824	
DTS	7.7	14.9	35,044	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32.7	29.7	162,459	
シーイーシー	7.7	7.7	17,409	
カブコン	30.5	33.1	86,821	
アイ・エス・ピー	1.7	—	—	
ジャストテック	5.8	6.4	7,168	
S C S K	18.6	16	92,320	
日本システムウエア	2.8	2.6	6,692	
アイネス	10.1	8.3	11,329	
T K C	5.9	5.7	29,241	
富士ソフト	10.4	9	38,475	
NSD	11.2	11.4	40,926	
コナミホールディングス	28.7	25.2	122,472	
福井コンピュータホールディングス	3	3	11,625	
J B C Cホールディングス	6.6	5.6	10,432	
ミロク情報サービス	7.3	6.3	21,325	
ソフトバンクグループ	292.8	548.1	2,321,751	
卸売業 (5.0%)				
伊藤忠食品	1.9	1.9	9,918	
エレマテック	3.8	8.1	8,561	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
J A L U X	2.4	2.7	6,806	
あらた	4	5.6	24,164	
東京エレクトロン デバイス	3.8	3.6	8,118	
フィールズ	7.8	8.5	4,241	
双日	387.2	378.2	132,748	
アルフレッサ ホールディングス	77.8	76.5	176,179	
横浜冷凍	19.1	20.7	22,356	
アルコニックス	8.7	8.3	12,010	
神戸物産	10.6	23.8	80,682	
あい ホールディングス	11.5	10.5	20,968	
ダイワボウホールディングス	6.4	5.9	32,922	
マクニカ・富士エレホールディングス	19	16.9	31,670	
ラクト・ジャパン	1.6	2.8	9,744	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13.3	13.5	14,958	
八洲電機	9	8.4	7,408	
レスターホールディングス	5.2	7.4	15,066	
ジュテックホールディングス	2.5	2.4	2,608	
T O K A Iホールディングス	36.7	36.2	40,109	
三洋貿易	4.4	4.1	9,643	
ウイン・パートナーズ	5.3	5.6	8,321	
シップヘルスケアホールディングス	14.5	11.2	51,296	
コメダホールディングス	16.6	15.9	33,787	
小野建	7.1	7.5	10,110	
佐鳥電機	6.6	7.3	6,679	
伯東	5.7	5.3	6,948	
コンドーテック	8	5.8	6,391	
ナガイレーベン	10.4	10.6	27,146	
三菱食品	7.5	7	20,524	
松田産業	6.2	5.8	9,088	
第一興商	10.7	10.6	57,452	
メディバルホールディングス	75.6	74.3	176,239	
S P K	2	2.6	7,410	
萩原電気ホールディングス	3.2	3.2	9,056	
アズワン	5	4.6	43,976	
尾家産業	4.1	3.6	4,849	
シモジマ	4.1	6.1	7,564	
ドウシシャ	6.5	6.8	12,308	
高速	6.5	5.5	6,512	
丸文	9	—	—	
ハビネット	6.3	6.7	9,594	
日本ライフライン	22.1	20.4	31,497	
エクセル	3.2	—	—	
マルカ	3.1	3.3	7,583	
I D O M	25.4	21	11,130	
日本エム・ディ・エム	4.8	—	—	
進和	4.8	4.7	11,054	
ダイトロン	3.9	3.9	6,618	
シークス	9.2	9.2	14,296	
オーハシテクニカ	5.7	5.7	8,333	
白銅	3.5	—	—	
伊藤忠商事	491.8	484.9	1,182,186	
丸紅	693.9	722.3	596,041	
長瀬産業	39.7	39	63,492	

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
蝶理	5.4	4.9	9,672	
豊田通商	77.8	77.4	300,699	
三共生興	16.8	15	9,015	
兼松	27.4	24.9	35,158	
三井物産	579.1	609.2	1,198,601	
日本紙パルプ商事	4.1	4.1	16,646	
日立ハイテクノロジーズ	21.4	24.1	172,797	
カメイ	9.9	9.6	11,779	
スターゼン	2.7	2.7	11,893	
山善	26.6	26.1	27,274	
椿本興業	2.2	1.6	6,432	
住友商事	415.9	437.8	725,215	
内田洋行	3.9	3.2	16,768	
三菱商事	493.2	486.7	1,415,080	
第一実業	3.5	3.8	14,117	
キャノンマーケティングジャパン	20.4	20.3	50,953	
西華産業	4.8	5.4	7,608	
佐藤商事	8	7.7	7,022	
菱洋エレクトロ	7.8	7.2	14,731	
東京産業	9.4	9.1	5,105	
ユアサ商事	7	6.2	21,700	
神鋼商事	2	2.2	5,838	
阪和興業	12.4	13.1	37,204	
正栄食品工業	3.8	4.7	15,909	
カナデン	8.2	7	9,275	
菱電商事	6.9	6.1	10,095	
フルサト工業	5.2	5.2	8,559	
岩谷産業	15.8	15.6	57,330	
極東貿易	3	3.2	7,020	
イワキ	10.8	12.3	5,854	
三愛石油	18.6	17.2	18,214	
稲畑産業	16.3	14.3	22,679	
明和産業	—	8.4	5,208	
ワキタ	15.7	15.7	17,191	
東邦ホールディングス	20.9	22.6	57,336	
サンゲツ	21.9	19	40,565	
ミツウロコグループホールディングス	11.9	10.7	15,194	
シナネンホールディングス	3.6	3.9	7,534	
伊藤忠エネクス	14.8	14.8	13,246	
サンリオ	22.5	19.5	43,563	
サンワテクノス	5.7	6.6	7,913	
リョーサン	8.2	7.7	22,691	
新光商事	7.4	11.7	10,530	
トーホー	4.1	4.3	8,053	
三信電気	6.2	4.4	7,480	
東陽テクニカ	11	10	11,400	
モスフードサービス	8.9	9.3	28,551	
加賀電子	7	7.1	17,522	
ソータニッカ	9.9	10.5	6,415	
立花エレクトック	6.1	5.8	10,196	
PALTAC	12.5	11	59,400	
太平洋興発	5.4	6.6	5,332	
西本Wisemittacホールディングス	1.7	1.7	6,655	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	株数	評価額
国際紙パルプ商事	—	—	20.5	6,170
ヤマタネ	4.8	4.8	7,219	
日鉄物産	4.7	4.6	23,322	
泉州電業	3	2.8	8,173	
トラスコ中山	14.3	14.2	39,745	
オートボックスセブン	28.5	26.1	47,006	
モリト	7.4	7.7	6,160	
加藤産業	10.6	10.6	38,849	
イノテック	5.8	5.8	6,101	
イエローハット	6.7	13.1	26,252	
JKホールディングス	10	9.3	6,017	
日伝	6.6	6.6	13,833	
杉本商事	4.8	4.7	9,423	
因幡電機産業	9.6	19.4	51,817	
バイテックホールディングス	3	—	—	
東テク	2.8	2.8	6,792	
ミスミグループ本社	88	86.7	237,384	
タキヒヨー	3.4	2.8	5,426	
スズケン	32	29.4	143,766	
ジェコス	6.5	7.2	6,876	
<b>小売業（4.7%）</b>				
ローソン	17.8	17.7	107,616	
サンエー	5.2	5.6	28,280	
カワチ薬品	6	5.5	12,677	
エービーシー・マート	11	10.8	80,568	
アスクル	6.1	7.5	22,537	
ゲオホールディングス	10.8	12.7	16,738	
アダストリア	10	9.8	24,852	
くら寿司	4.2	3.7	18,074	
キャンドゥ	5.1	5	8,175	
バルグループホールディングス	3.9	3.7	13,227	
エディオン	29.3	31.1	36,915	
サーラコーポレーション	16.6	16.3	10,154	
ハローズ	3.1	2.9	7,482	
フジオフードシステム	—	3.4	12,138	
あみやき亭	1.9	2.2	8,019	
ひらまつ	19.6	20.5	6,252	
大黒天物産	2	2.1	6,741	
ハニーズホールディングス	8.8	7.1	9,869	
アルベン	6	5.9	10,856	
クオールホールディングス	10.5	10.6	16,790	
ジンスホールディングス	4.9	3.8	25,536	
ビックカメラ	37.1	40.3	48,883	
DCMホールディングス	37	36.4	38,911	
ペッパーフードサービス	5.7	—	—	
Monotaro	44.8	49.4	152,399	
DDホールディングス	2	3.3	5,171	
アークランドサービスホールディングス	5.5	5.6	10,477	
J. フロント リテイリング	90.1	82.7	121,817	
ドトール・日レスホールディングス	12.1	10.5	23,446	
マツモトキヨシホールディングス	29.1	28.4	119,280	
ブロンコビリー	3.9	3.9	10,689	
ZOZO	76.3	48	105,888	

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
物語コーポレーション	2.1	1.8	15,534	
ココカラファイン	7.8	7.2	46,368	
三越伊勢丹ホールディングス	131.3	121.4	120,186	
Homee	2.2	2.8	3,914	
ウエルシアホールディングス	18.5	20.6	139,874	
クリエイトSDホールディングス	10.1	9.5	25,422	
チムニー	2.8	3	6,924	
シュッピン	5.3	5.9	6,885	
ネクステージ	11	10.3	12,308	
ジョイフル本田	20.3	20.4	29,845	
鳥貴族	2.9	3	5,691	
キリン堂ホールディングス	3.4	3.2	6,588	
ホットランド	5.1	6.3	8,523	
すかいらーくホールディングス	65.8	77.9	172,704	
SFPホールディングス	—	3.7	8,140	
綿半ホールディングス	3.1	3.1	6,246	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	19	18.5	18,148	
B E E N O S	—	3.4	5,232	
あさひ	6.7	6.2	7,830	
日本調剤	2.7	2.3	8,694	
コスモス薬品	3.6	3.1	68,975	
セブン&アイ・ホールディングス	294.5	271.5	1,116,679	
薬王堂	3.1	—	—	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	18.8	18.6	34,242	
ツルハホールディングス	15.3	15	196,050	
サンマルクホールディングス	5.4	5.4	12,592	
トリドールホールディングス	8.9	8.7	25,047	
T O K Y O B A S E	7.3	7.3	5,234	
ジャパンミート	3.1	3.9	8,443	
アレンザホールディングス	5	—	—	
パロックジャパンリミテッド	6.9	6.7	6,338	
クスリのアオキホールディングス	5.5	6.9	57,201	
力の源ホールディングス	—	4.1	3,575	
スシローグローバルホールディングス	7.8	7.6	65,056	
L I X I L ビバ	6.2	7	13,419	
メディカルシステムネットワーク	9.6	9.2	5,299	
ノジマ	12.4	11.6	26,459	
カップ・クリエイト	11.2	10.2	14,943	
ライトオン	7.6	—	—	
良品計画	10	92	229,816	
三城ホールディングス	14.5	—	—	
アドヴァン	12.3	11.3	14,780	
アルビス	3.1	3.3	7,566	
コナカ	13.8	15.2	6,171	
G-7ホールディングス	2.6	2.1	9,450	
イオン北海道	10.1	8.4	6,711	
コジマ	12.8	14.1	6,471	
コーナン商事	9.2	9.4	23,951	
エコス	3.1	3.3	5,553	
ワタミ	10.3	9	11,808	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	45.6	166	298,468	
西松屋チェーン	15.6	15.4	15,477	
ゼンショーホールディングス	33.6	33.5	84,219	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
幸楽苑ホールディングス	6.2	5.2	11,008	
サイゼリヤ	11.5	11.4	29,993	
V Tホールディングス	26	30.1	14,237	
フジ・コーポレーション	—	2.5	5,810	
ユナイテッドアローズ	8.1	7.5	25,050	
ハイデイ日高	9.1	9.6	20,995	
コロワイド	23.2	23.9	52,962	
ピーシーデポコーポレーション	10.8	11.8	5,640	
壱番屋	4.9	4.9	25,872	
スギホールディングス	15.5	13.9	85,763	
薬王堂ホールディングス	—	3.2	8,102	
ヴィア・ホールディングス	11.8	13.3	8,871	
スクロール	12.7	15.8	5,530	
ヨンドシーホールディングス	7.9	7.3	19,074	
ファミリーマート	19.6	55.5	144,355	
木曾路	8.5	9.1	26,208	
S R Sホールディングス	10.4	11.2	11,692	
千趣会	—	17.8	7,689	
ケーヨー	17	18.8	10,133	
上新電機	8.3	8	19,720	
日本瓦斯	12.9	11.2	38,528	
ロイヤルホールディングス	12.2	11.8	29,995	
いなげや	7.7	8.9	13,172	
島忠	16.1	13.2	39,666	
チヨダ	7.3	7.6	12,289	
ライフコーポレーション	5.2	5.4	13,521	
リンガーハット	8.9	8.8	21,859	
M r M a x H D	11.8	12.5	6,237	
A O K Iホールディングス	13.8	13.6	15,422	
オークワ	11	11	15,873	
コメリ	11.3	10.5	24,811	
青山商事	13.7	14.6	24,484	
しまむら	8.2	8	71,760	
高島屋	55.4	51.6	67,286	
松屋	14.9	14.9	12,724	
エイチ・ツー・オー リテイリング	36.3	33	40,689	
近鉄百貨店	2.7	2.8	10,108	
バルコ	7.7	7.2	9,820	
丸井グループ	59.6	63.6	168,603	
アクシアル リテイリング	5.7	5.6	21,672	
イオン	270.5	266.4	603,396	
イズミ	14.3	14.2	60,634	
平和堂	13.8	13.6	28,764	
フジ	8.6	8.5	16,753	
ヤオコー	7.7	7.6	38,836	
ゼビオホールディングス	8.1	8.8	11,686	
ケーズホールディングス	73.2	67.1	91,658	
O l y m p i c グループ	5.8	6.3	4,101	
日産東京販売ホールディングス	17.8	17.8	4,948	
Genky DrugStores	2.9	3.7	9,394	
総合メディカルホールディングス	6.1	6.3	13,009	
ブックオフグループホールディングス	—	4.9	5,223	
アインホールディングス	9.5	9.5	65,360	

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
元気寿司	2.1	2.4	7,185	
ヤマダ電機	215.5	210.5	117,248	
アークランドサカモト	11.9	10.9	13,962	
ニトリホールディングス	30.5	30	517,800	
グルメ軒屋	8.2	6.2	7,409	
吉野家ホールディングス	25.5	23.5	64,766	
松屋フーズホールディングス	3.3	3.3	14,883	
サガミホールディングス	10.4	9.8	13,484	
関西スーパーマーケット	6.9	6.6	7,167	
王将フードサービス	5.1	5	33,100	
ブレナス	7.7	7.8	15,100	
ミニストップ	5.6	5.8	8,537	
アークス	12.8	13.4	30,605	
パローホールディングス	15.5	14.8	30,547	
ベルク	3.4	3.2	16,736	
大庄	5.5	5.2	8,346	
ファーストリテイリング	9.4	9.3	630,540	
サンドラッグ	26.4	26	100,620	
サクスパーホールディングス	7.3	8.3	7,511	
ペルーナ	17.3	15.3	10,893	
<b>銀行業（5.8%）</b>				
じもとホールディングス	60.3	59.1	6,323	
めぶきフィナンシャルグループ	365.5	361.1	102,552	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10	10	15,320	
九州フィナンシャルグループ	113.5	112.6	55,511	
ゆうちょ銀行	198.4	196.3	210,041	
富山第一銀行	21.6	19.6	6,781	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	446.2	409.1	182,867	
西日本フィナンシャルホールディングス	45.9	47.3	40,488	
関西みらいフィナンシャルグループ	33.3	41.1	30,085	
三十三フィナンシャルグループ	7	6.5	11,102	
第四北越フィナンシャルグループ	12.2	12.1	36,360	
新生銀行	50.8	50.8	87,223	
あおぞら銀行	38.7	41.1	115,819	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,902	4,780.6	2,782,787	
リソナホールディングス	768.8	760.7	355,094	
三井住友トラスト・ホールディングス	137.6	131.1	549,964	
三井住友フィナンシャルグループ	495.8	480.3	1,925,042	
千葉銀行	247	238.2	148,636	
群馬銀行	138.4	135.4	52,806	
武蔵野銀行	10.6	10.6	20,786	
千葉興業銀行	23.6	20.6	7,086	
筑波銀行	36.8	30.8	7,484	
七十七銀行	21.9	23.7	42,517	
青森銀行	6.1	5.4	15,287	
秋田銀行	5.3	5.2	11,746	
山形銀行	8.2	8.7	14,433	
岩手銀行	5.1	5	14,825	
東邦銀行	63.4	60	16,680	
東北銀行	5.5	4	4,136	
みちのく銀行	5.5	5	7,835	
ふくおかフィナンシャルグループ	56.7	58.3	121,963	
静岡銀行	175.7	171.2	143,636	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
十六銀行	9.4	9	23,958	
スルガ銀行	69.8	72.7	39,621	
八十二銀行	122.9	166.8	79,230	
山梨中央銀行	9.3	9.2	10,616	
大垣共立銀行	11	13.7	34,935	
福井銀行	6.9	5.9	10,230	
北國銀行	7.8	7.6	26,676	
清水銀行	3.9	2.9	6,322	
富山銀行	1.7	1.6	4,225	
滋賀銀行	13.9	13.7	37,579	
南都銀行	8.6	11.9	32,879	
百五銀行	62.9	64.7	22,903	
京都銀行	25	24.7	113,126	
紀陽銀行	24.8	24.5	42,238	
ほくほくフィナンシャルグループ	46.3	46.8	53,071	
広島銀行	101.8	101.2	55,154	
山陰合同銀行	42	42	28,854	
中国銀行	45	60	65,820	
伊予銀行	91.4	97.6	59,340	
百十四銀行	7.8	7.6	17,160	
四国銀行	11.1	10.4	10,868	
阿波銀行	11.1	11.4	30,848	
大分銀行	4.6	4.2	11,986	
宮崎銀行	5.2	4.5	11,947	
佐賀銀行	4.7	4.7	8,178	
十八銀行	4.6	—	—	
沖縄銀行	6.6	6.5	23,887	
琉球銀行	17	15.7	19,750	
セブン銀行	237.5	235.6	80,339	
みずほフィナンシャルグループ	9,556	9,433.6	1,600,881	
山口フィナンシャルグループ	86.6	87.8	66,464	
名古屋銀行	6	6	20,340	
北洋銀行	107.2	108.3	26,100	
愛知銀行	2.8	2.9	11,150	
中京銀行	3.7	3	6,771	
大光銀行	3.5	2.5	4,377	
愛媛銀行	11	10.2	12,484	
京葉銀行	31	30.8	19,373	
栃木銀行	39.2	39.6	9,147	
北日本銀行	3	—	—	
東和銀行	13.8	12.3	10,922	
福島銀行	10	—	—	
トモニホールディングス	57	57.6	24,134	
フィデアホールディングス	83	73	9,782	
池田泉州ホールディングス	77.8	78.2	15,874	
<b>証券・商品先物取引業（0.8%）</b>				
F P G	23.2	22.8	24,373	
S B Iホールディングス	83.8	77.7	175,446	
ジャフコ	11.7	10.6	44,838	
大和証券グループ本社	563.5	557.3	309,914	
野村ホールディングス	1,291	1,223.1	687,749	
岡三証券グループ	61.4	62.6	25,415	
丸三証券	23	22.5	12,307	

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		
東洋証券	32	—	—	—
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	84.3	82.4	27,851	—
水戸証券	24	26.5	7,499	—
いちよし証券	16	13.6	9,275	—
松井証券	34.5	40.9	36,319	—
マネックスグループ	66.5	56.1	15,764	—
カブドットコム証券	55.2	—	—	—
極東証券	10	11.1	8,713	—
岩井コスモホールディングス	8	8	10,256	—
藍澤證券	15.4	12.5	9,225	—
スパークス・グループ	—	30	7,470	—
<b>保険業（2.3%）</b>				
かんぽ生命保険	26.6	24.9	46,712	—
SOMPOホールディングス	137.9	130.6	570,852	—
アニコムホールディングス	5.9	5.8	20,793	—
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	183.8	181.7	646,852	—
ソニーフィナンシャルホールディングス	57.7	56.9	146,403	—
第一生命ホールディングス	398	393.1	692,445	—
東京海上ホールディングス	255	248.3	1,494,766	—
T&Dホールディングス	216.9	214.5	277,777	—
アドバンスクリエイト	4	1.5	2,796	—
<b>その他金融業（1.2%）</b>				
全国保証	20.2	19.6	86,436	—
C a s a	—	3	3,789	—
アルヒ	7	11.2	28,168	—
プレミアグループ	—	4	9,344	—
クレディセゾン	49.4	48.9	88,509	—
芙蓉総合リース	8.1	7.3	52,779	—
みずほリース	13.7	10.9	35,752	—
東京センチュリー	14.1	14	83,860	—
日本証券金融	34.2	32.2	17,484	—
アイフル	113.3	111.7	28,148	—
リコーリース	5.8	5.8	22,678	—
イオンフィナンシャルサービス	44.7	42.5	71,612	—
アコム	142.3	138.8	63,570	—
ジャックス	8.7	7.8	21,028	—
オリエントコーポレーション	194	195.6	31,687	—
日立キャピタル	16.7	16.2	43,659	—
アブラスフィナンシャル	—	44.1	4,101	—
オリックス	469.5	434.3	780,654	—
三菱UFJリース	158.2	176.2	124,221	—
日本取引所グループ	190.2	199.5	373,863	—
イー・ギャランティ	8	7.1	10,053	—
NECキャピタルソリューション	3.3	3.3	8,127	—
<b>不動産業（2.4%）</b>				
いちご	90.3	90.2	39,597	—
日本駐車場開発	90.4	85.3	14,159	—
スター・マイカ・ホールディングス	—	4.5	7,992	—
ヒューリック	147	149	186,846	—
三栄建築設計	3.6	4	6,500	—
スター・マイカ	4	—	—	—
野村不動産ホールディングス	46.8	42.2	111,956	—
三重交通グループホールディングス	16.4	18	10,872	—

銘柄	期首(前期末)		期	末
	株数	株数		
サムティ	10.2	9.9	20,077	—
ディア・ライフ	10.1	10.3	5,757	—
日本商業開発	5.1	6.1	9,796	—
プレサンスコーポレーション	11.4	11.1	19,491	—
ユニゾホールディングス	11	10.8	52,920	—
日本管理センター	5.8	5.8	7,650	—
フージャースホールディングス	17.4	16.6	11,736	—
オープンハウス	11.5	20.1	58,692	—
東急不動産ホールディングス	189.1	188.2	140,020	—
飯田グループホールディングス	58.7	56.6	110,539	—
ムゲンエステート	6.5	8.2	6,560	—
ヒーロット	—	2.5	5,077	—
ハウスドゥ	2.9	4.8	7,771	—
ジェイ・エス・ビー	—	1.2	5,544	—
パーク24	41.3	37.7	97,077	—
バラカ	2.8	3.1	6,302	—
三井不動産	373.5	347.3	948,649	—
三菱地所	493.4	487	978,870	—
平和不動産	13.5	13	33,982	—
東京建物	77.5	77	127,281	—
ダイビル	20.7	18.4	21,564	—
京阪神ビルディング	15	12.1	17,387	—
住友不動産	158.4	156.5	600,803	—
大京	10.8	—	—	—
テーオーシー	16.7	15	13,425	—
東京楽天地	1.8	1.7	10,438	—
レオパレス21	91.4	—	—	—
スターツコーポレーション	9.3	9.2	24,757	—
フジ住宅	11.8	11.8	8,389	—
空港施設	13.3	13.3	7,182	—
ゴールドクレスト	6.2	5.9	12,755	—
エスリード	4.2	3.8	8,249	—
日神不動産	13.5	14.1	6,993	—
日本エスコン	14.1	14.1	13,944	—
タカラレーベン	35.8	33.5	16,381	—
サンヨーハウジング名古屋	7	7	6,965	—
イオンモール	35.4	35.7	63,367	—
ファースト住建	—	5.2	6,858	—
カチタス	8	8.8	43,296	—
トーセイ	10.8	9.9	13,196	—
エヌ・ティ・ティ都市開発	44	—	—	—
サンフロンティア不動産	10.5	10.2	12,994	—
エフ・ジェー・ネクスト	8.2	7.8	8,330	—
ランドビジネス	—	7.4	5,631	—
日本空港ビルデング	22.6	22.4	130,592	—
<b>サービス業（5.1%）</b>				
日本工営	5	4.6	15,548	—
L I F U L L	24.4	24.8	13,764	—
ジェイエイシーリクルートメント	5.9	5	10,460	—
日本M&Aセンター	51.3	50.9	190,875	—
メンバーズ	—	2.3	5,423	—
タケエイ	9.9	8.1	10,392	—
トラスト・テック	3.4	8.1	10,959	—

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
コシダカホールディングス	18.5	16.6	26,709	
パソナグループ	7	8.4	14,338	
リンクアンドモチベーション	12.9	16.3	11,833	
GCA	8.5	9.8	9,339	
エス・エム・エス	25.3	21.3	64,006	
パーソルホールディングス	68.3	67.3	136,888	
リニカル	4.4	4.7	5,546	
クックパッド	23.9	28.3	10,527	
学情	3.6	3.4	5,402	
スタジオアリス	3.8	4.3	8,380	
シミックホールディングス	4.4	4.7	8,544	
総合警備保障	27.1	26.7	155,127	
カカコム	51.9	50.8	134,823	
アイロムグループ	3.1	3.3	4,804	
ルネサンス	4.3	4.9	8,555	
ディップ	10.9	9.5	29,592	
オプトホールディング	4.5	4.2	7,488	
新日本科学	11.6	9.3	7,309	
ツクイ	16.6	18.4	10,451	
ベネフィット・ワン	—	18.1	43,892	
エムスリー	143.9	148.3	453,056	
アウトソーシング	36	38.3	46,036	
ウェルネット	8.4	9.1	7,471	
ワールドホールディングス	2.2	2.7	5,316	
ディー・エヌ・エー	37.1	33.7	59,986	
博報堂D Yホールディングス	94.3	93	166,284	
ぐるなび	10.7	13.5	14,107	
タカミヤ	9.4	9.4	6,796	
ジャパンベストレスキューシステム	6.3	5.6	6,053	
ファンコミュニケーションズ	20.2	21	10,605	
ライク	3.3	3.2	5,430	
エスプール	—	14.2	10,096	
WD Bホールディングス	3.4	3.3	8,362	
バリューコマース	5	4.3	8,604	
インフォマート	38	37.5	72,750	
J Pホールディングス	25.4	27.2	7,996	
E P Sホールディングス	10.4	10.7	15,375	
プレステージ・インターナショナル	13.4	26	24,024	
アミューズ	4.3	4.1	12,792	
ドリームインキュベータ	2.9	3.1	5,177	
クイック	4.7	4.9	8,246	
ケネディクス	64.9	65.4	38,324	
電通	83	69.2	279,914	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3	3.4	4,522	
びあ	2.1	2.1	10,122	
イオンファンタジー	2.3	2.8	8,848	
シーティーエス	9.2	9	6,777	
ネクシィーズグループ	2.4	2.8	5,269	
みらかホールディングス	19.5	19.4	53,369	
アルプス技研	6.1	6.3	11,497	
日本空調サービス	9.6	9.6	7,516	
オリエンタルランド	80.6	71.5	1,085,370	
ダスキン	18.6	17.4	53,070	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
明光ネットワークジャパン	10.2	10.1	10,413	
ファルコホールディングス	5.2	5.1	8,991	
ラウンドワン	21.4	19.3	21,365	
リゾートトラスト	29.5	31.7	58,518	
ビー・エム・エル	8.8	8.6	27,563	
りらいあコミュニケーションズ	12.1	12.2	17,287	
リソー教育	36.3	32.3	13,339	
ユー・エス・エス	83.4	75.4	160,677	
サイバーエージェント	42.2	39	149,370	
楽天	319.7	313.9	295,693	
クリーク・アンド・リバー社	4.9	4.5	5,062	
テー・オー・ダブリュー	8.3	8.3	6,972	
山田コンサルティンクグループ	—	3.8	6,938	
セントラルスポーツ	2.9	2.9	9,483	
フルキャストホールディングス	6.8	6.6	16,401	
エン・ジャパン	7.6	11.9	60,928	
テクノプロ・ホールディングス	13	13.5	100,980	
アイ・アールジャパンホールディングス	—	3.1	13,051	
Gunosy	4.4	5.3	8,787	
イー・ガーディアン	3.6	3.6	8,078	
ジャパンマテリアル	18.9	20.6	31,106	
ベクトル	8.6	9.3	10,592	
チャーム・ケア・コーポレーション	—	2.5	4,882	
I B J	—	5.6	6,025	
アサンテ	3.5	3.7	7,499	
N・フィールド	5	7	4,921	
バリューHR	2.2	1.7	5,958	
M&Aキャピタルパートナーズ	1.8	4.8	20,640	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.7	3.7	7,185	
アビスト	1.4	—	—	
シグマクシス	4.4	5	11,255	
ウィルグループ	5.4	5.1	5,900	
エスクロー・エージェント・ジャパン	11.5	—	—	
リクルートホールディングス	488.7	481.7	1,916,202	
エラン	2.6	4.4	7,524	
日本郵政	556.7	551.6	571,733	
ベルシステム24ホールディングス	11.6	11.6	19,940	
鎌倉新書	5.4	5.4	10,411	
LITALICO	2	2.9	7,777	
エポラブルアジア	2.4	3.5	7,710	
アトラエ	—	2	7,670	
ストライク	1.9	2.6	11,388	
ソラスト	17	18.9	24,702	
インソース	2.5	3.5	12,022	
ベイカレント・コンサルティング	—	4.2	25,032	
キャリアインデックス	2.8	—	—	
MS - Japan	3.2	—	—	
グレイステクノロジー	2	3.3	9,771	
ジャパンエレベーターサービスホールディング	4.5	7.3	21,410	
グリーンズ	—	4.3	5,254	
日総工産	2	5.2	5,631	
キュービーネットホールディングス	4	4.7	11,740	
RPAホールディングス	—	4.4	5,513	

## 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
スプリックス	2.2	3.1	3,906	
アドバンテッジリスクマネジメント	—	4.7	4,653	
リログループ	37.4	36.8	109,884	
東祥	4.3	4.8	11,779	
エイチ・アイ・エス	12	10.6	32,542	
共立メンテナンス	10.4	11	57,200	
イチネンホールディングス	8.5	8.3	11,744	
建設技術研究所	5.7	5.6	11,368	
スペース	5.3	—	—	
燦ホールディングス	2.3	4.4	5,931	
東京テアトル	4.9	4.7	6,547	
ナガワ	2	2.1	15,813	
よみうりランド	2.3	2.1	9,534	
東京都競馬	4.6	4.6	15,985	
常盤興産	5.3	4.9	8,168	
カナモト	9.7	11.1	35,131	
東京ドーム	25.8	28.2	28,566	
西尾レントオール	7	6.8	20,978	
トランス・コスモス	7.5	6.4	18,393	
乃村工務社	15.9	28.8	40,608	
藤田観光	3.3	3.7	10,611	
KNT-CTホールディングス	4.3	4.8	7,252	
日本管財	7	6.4	12,486	
トーカイ	6.6	6.6	18,935	
セコム	72.4	71.3	676,351	
セントラル警備保障	3.4	3.3	21,318	
丹青社	13.2	13.1	16,139	
メイテック	8.9	8.5	49,555	
応用地質	8.3	7.9	11,060	
船井総研ホールディングス	14.1	13.7	34,880	
オオバ	7.8	8.2	6,543	
学究社	4.2	—	—	
ベネッセホールディングス	25.1	22.7	66,011	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
イオンディライト	8.2	8.1	31,347	
ナック	6	6	6,336	
ニチイ学館	10.5	9.9	16,047	
ダイセキ	11.4	11.3	36,838	
合計	株数・金額	81,162	81,710	170,406,746
	銘柄数<比率>	1,659	1,661	<97.7%>

※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。

※評価額の単位未満は切捨て。ただし、評価額が単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

### (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 株式先物取引 TOPIX	百万円 3,999	百万円 —

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

## ■ 投資信託財産の構成

(2019年12月2日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円	%
株	170,406,746	97.5
コール・ローン等、その他	4,281,756	2.5
投資信託財産総額	174,688,502	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## 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

(2019年12月2日現在)

項 目	期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>176,445,102,542円</b>
コール・ローン等	3,379,265,534
株式(評価額)	170,406,746,760
未 収 入 金	72,899,200
未 収 配 当 金	857,351,048
差入委託証拠金	1,728,840,000
<b>(B) 負 債</b>	<b>2,046,808,561</b>
未 払 解 約 金	290,138,959
未 払 利 息	6,480
差入委託証拠金代用有価証券	1,756,600,000
その他未払費用	63,122
<b>(C) 純 資 産 総 額(A-B)</b>	<b>174,398,293,981</b>
元 本	63,743,430,458
次 期 繰 越 損 益 金	110,654,863,523
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>63,743,430,458口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	27,359円

※当期における期首元本額66,912,228,971円、期中追加設定元本額13,207,087,179円、期中一部解約元本額16,375,885,692円です。

※代用として、担保に供している資産は、株式3,095,200,000円です。(受渡しベース)

※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2018年12月1日 至2019年12月2日)

項 目	当 期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>4,180,864,487円</b>
受 取 配 当 金	4,179,624,536
そ の 他 収 益 金	2,800,929
支 払 利 息	△ 1,560,978
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>4,923,794,035</b>
売 買 益	16,144,533,878
売 買 損	△ 11,220,739,843
<b>(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益</b>	<b>321,575,500</b>
取 引 益	860,998,660
取 引 損	△ 539,423,160
<b>(D) 信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 1,078,963</b>
<b>(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)</b>	<b>9,425,155,059</b>
<b>(F) 前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>106,635,545,407</b>
<b>(G) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>19,374,291,115</b>
<b>(H) 解 約 差 損 益 金</b>	<b>△ 24,780,128,058</b>
<b>(I) 計 (E+F+G+H)</b>	<b>110,654,863,523</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金(I)</b>	<b>110,654,863,523</b>

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

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※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。

※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	10,093,895,533円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,366,581,213円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	871,994,826円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	55,996,005円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,134,711,529円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	212,637,976円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,984,021,207円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	794,882円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	171,270,930円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	882,312,334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）	6,770,604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>	55,058,558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）	24,018,495円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	363,346,655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）	65,633,993円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,058,492,761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）	108,427,212円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	861,659,534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）	71,148,493円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	2,778,991,517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）	157,127,838円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,137,750円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,522,887,951円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	58,214,802円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	11,405,867,081円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	71,457,145円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	750,808,584円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	44,386,681円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	754,464,975円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	21,663,542円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	588,252,205円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	179,161,011円
イオン・バランス戦略ファンド	102,533,812円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	345,072,882円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	11,657,198円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	11,140,518円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	55,140,191円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	111,594,783円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	50,085,566円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	58,092,653円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	139,661,373円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,215,706円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	75,363,090円	SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	70,883,973円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	94,884,854円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	848,254,810円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	12,899,750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）	194,795,060円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	407,382円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	19,380,760円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	77,860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>	1,164,508,623円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	137,846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>	193,275,461円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	198,857円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,504,949,363円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,810,058,037円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	111,253,748円
バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定>	22,375,907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>	14,465,450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>	218,475,561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>	81,986,207円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	3,018,643,305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>	51,058,228円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	2,309,967,382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>	307,740,440円

### ■ お知らせ

#### <約款変更について>

・委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
（適用日：2019年4月1日）

# SMAM・年金国内債券パッシブファンド 〈適格機関投資家限定〉

(2018年6月21日から2019年6月20日まで)

第 15 期

決算日 2019年6月20日

## ■当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2004年5月21日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、NOMURA-BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指します。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド 日本の公社債および短期金融資産
当ファンドの運用方法	■マザーファンドおよび日本の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ■マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、ファンド設定当初や解約・償還への対応などの事情により変更することもあります。
組入制限	当ファンド ■株式への投資は、転換社債の転換、ならびに新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ■外貨建資産への投資は行いません。 国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	年1回（毎年6月20日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、以下の方針に基づき収益分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

■ 1 万 口 当 た り の 費 用 明 細 ( 2 0 1 8 年 6 月 2 1 日 か ら 2 0 1 9 年 6 月 2 0 日 まで )

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 信託報酬	7円	0.054%	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)
(投信会社)	(2)	(0.014)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(2)	(0.013)	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)	(4)	(0.027)	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) その他費用	0	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
(監査費用)	(0)	(0.003)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	7	0.058	

期中の平均基準価額は12,971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。

※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。

■ 当 期 中 の 売 買 及 び 取 引 の 状 況 ( 2 0 1 8 年 6 月 2 1 日 か ら 2 0 1 9 年 6 月 2 0 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
国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンド	2,738,024	3,852,886	3,065,590	4,275,960

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 組 入 れ 資 産 の 明 細 ( 2 0 1 9 年 6 月 2 0 日 現 在 )

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期	末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンド	22,456,176	22,128,610	31,812,089

※国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンドの期末の受益権総口数は80,135,880千口です。

※単位未満は切捨て。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年6月20日現在)

項 目	期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>31,817,351,765円</b>
コール・ローン等	11,979
国内債券(NOMURA-BPI) マザーファンド(評価額)	31,812,089,786
未 収 入 金	5,250,000
<b>(B) 負 債</b>	<b>13,805,084</b>
未 払 解 約 金	5,250,000
未 払 信 託 報 酬	8,069,084
そ の 他 未 払 費 用	486,000
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>31,803,546,681</b>
元 本	23,899,072,188
次 期 繰 越 損 益 金	7,904,474,493
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>23,899,072,188口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>13,307円</b>

※当期における期首元本額24,238,325,216円、期中追加設定元本額3,001,984,586円、期中一部解約元本額3,341,237,614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2018年6月21日 至2019年6月20日)

項 目	当 期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>△ 342円</b>
支 払 利 息	△ 342
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>898,938,174</b>
売 買 益	946,647,612
売 買 損	△ 47,709,438
<b>(C) 信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 16,943,217</b>
<b>(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)</b>	<b>881,994,615</b>
<b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>3,504,536,814</b>
<b>(F) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>3,517,943,064</b>
( 配 当 等 相 当 額 )	( 3,722,414,877)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 204,471,813)
<b>(G) 計 (D+E+F)</b>	<b>7,904,474,493</b>
<b>(H) 収 益 分 配 金</b>	<b>0</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)</b>	<b>7,904,474,493</b>
追 加 信 託 差 損 益 金	3,517,943,064
( 配 当 等 相 当 額 )	( 3,724,817,328)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 206,874,264)
分 配 準 備 積 立 金	4,695,727,786
繰 越 損 益 金	△ 309,196,357

※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。  
 ※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。  
 ※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。  
 ※期末における、費用控除後の配当等収益(285,301,447円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(3,724,817,328円)および分配準備積立金(4,410,426,339円)より分配可能額は8,420,545,114円(1万口当たり3,523円)ですが、分配は行っておりません。

# 国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド

第19期(2018年6月21日から2019年6月20日まで)

信託期間	無期限(設定日:2000年6月21日)
運用方針	主として日本の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク)NOMURA-BPI		債券組入 比率	純資産 総額
	円	騰落率	(総合)	騰落率		
15期(2015年6月22日)	13,233	2.4%	363.07	2.4%	99.1%	125,905 百万円
16期(2016年6月20日)	14,175	7.1	388.79	7.1	99.3	115,394
17期(2017年6月20日)	13,844	△2.3	379.60	△2.4	99.2	111,362
18期(2018年6月20日)	13,955	0.8	382.52	0.8	99.2	107,741
19期(2019年6月20日)	14,376	3.0	393.94	3.0	99.5	115,199

※NOMURA-BPI(総合)は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證券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、野村證券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		債券組入 比率
	円	騰落率	(総合)	騰落率	
(期首) 2018年6月20日	13,955	—	382.52	—	99.2%
6月末	13,960	0.0	382.67	0.0	98.9
7月末	13,935	△0.1	381.98	△0.1	99.3
8月末	13,860	△0.7	379.89	△0.7	99.3
9月末	13,826	△0.9	378.99	△0.9	99.4
10月末	13,851	△0.7	379.64	△0.8	99.4
11月末	13,909	△0.3	381.24	△0.3	99.3
12月末	14,011	0.4	384.13	0.4	99.4
2019年1月末	14,068	0.8	385.58	0.8	99.4
2月末	14,098	1.0	386.43	1.0	99.2
3月末	14,197	1.7	389.14	1.7	99.5
4月末	14,153	1.4	387.94	1.4	99.5
5月末	14,242	2.1	390.32	2.0	99.4
(期末) 2019年6月20日	14,376	3.0	393.94	3.0	99.5

※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 (2018年6月21日から2019年6月20日まで)

### 基準価額等の推移



期首	13,955円
期末	14,376円
騰落率	+3.0%

※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、NOMURA-BPI（総合）です。

※NOMURA-BPI（総合）は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村証券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、野村証券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 (2018年6月21日から2019年6月20日まで)

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

### 上昇要因

- ・10月以降、米中貿易摩擦問題への警戒感や世界的な景気減速懸念を背景に、国内金利が低下（債券価格は上昇）したこと
- ・景気下振れリスクへの警戒感から欧米で利下げ観測が高まるなか、海外金利の低下に追随し、期末にかけて国内金利の低下が進行したこと

### 下落要因

- ・7月、日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の許容変動幅を従来の倍程度としたことから国内金利が上昇（債券価格は下落）したこと

### ▶ 投資環境について (2018年6月21日から2019年6月20日まで)

日本の長期金利の代表である10年国債利回りは低下（債券価格は上昇）しました。

長期金利は、期首からしばらくは0.0%台の狭い範囲で推移しましたが、7月末に日銀が緩和継続のための枠組み強化策を発表し、長期金利の変動幅を従来の倍程度とすると、8月上旬には0.1%台半ばへと上昇しました。しかし、急速な金利上昇に対して日銀が臨時の国債買入れオペを実施したため、長期金利は低下に転じました。

10月には米国での利上げ観測を背景に海外金利が上昇していたこともあり、長期金利は再度0.1%台半ばへと上昇する場面もありました。しかしその後は、米中貿易摩擦問題や英国のEU（欧州連合）離脱問題が警戒されるなか、株価の下落とともに長期金利は低下基調で推移しました。

期末にかけても、米中貿易摩擦問題や世界的に景気減速への警戒感が高まるなかで、欧米中央銀行がハト派（景気を重視する立場）化姿勢を示したことから、海外金利の低下とともに、国内長期金利は-0.1%台後半へ低下しました。

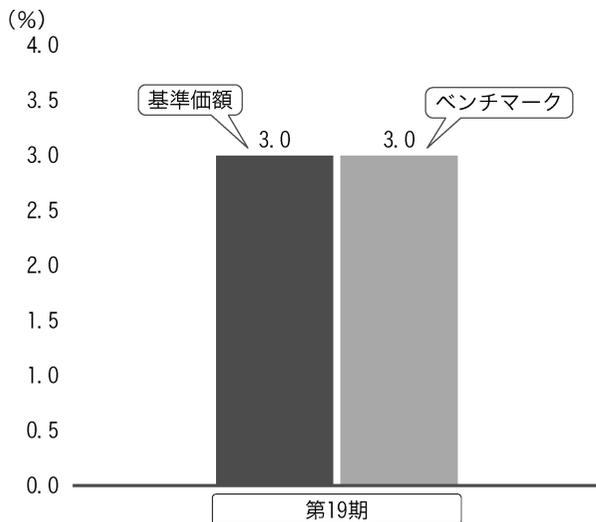
当期の市場の動きを10年国債利回りでみると、期首の0.039%から期末には-0.165%へ低下しました。

### ▶ ポートフォリオについて (2018年6月21日から2019年6月20日まで)

デュレーション（投資資金の平均回収期間）、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 (2018年6月21日から2019年6月20日まで)

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



当ファンドは、NOMURA-BPI（総合）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】

当期における基準価額の騰落率は+3.0%となり、ベンチマークの騰落率+3.0%に概ね連動した運用成果となりました。

## 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（NOMURA-BPI）マザーファンド

### ■ 1万口当たりの費用明細(2018年6月21日から2019年6月20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14,009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(2018年6月21日から2019年6月20日まで)

#### 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	20,295,971	15,306,951
	地方債証券	2,758,624	2,212,530 (246,000)
	特殊債証券	2,080,870	1,709,431 (941,587)
	社債証券 (投資法人債券を含む)	1,448,243	200,682 (400,000)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※( )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(投資法人債券を含む)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(2018年6月21日から2019年6月20日まで)

#### (1) 利害関係人との取引状況

区分	買付額等	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	A			C		
公社債	百万円 26,583	百万円 4,179	% 15.7	百万円 19,429	百万円 1,905	% 9.8

#### (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
公社債	百万円 -	百万円 -	百万円 202

## 国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

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

種 類	買 付 額
公 社 債	百万円 800

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、株式会社三井住友銀行、株式会社三井住友フィナンシャルグループ、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 (2018年6月21日から2019年6月20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(2019年6月20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				未		
	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	79,723,000 (10,957,000)	89,776,323 (12,463,939)	77.9 (10.8)	— (—)	55.4 (9.4)	17.3 (1.4)	5.2 (—)
地 方 債 証 券	8,150,000 (8,150,000)	8,553,989 (8,553,989)	7.4 (7.4)	— (—)	3.6 (3.6)	1.9 (1.9)	1.9 (1.9)
特 殊 債 券 ( 除 く 金 融 債 )	9,308,992 (9,308,992)	9,922,576 (9,922,576)	8.6 (8.6)	— (—)	4.6 (4.6)	2.2 (2.2)	1.8 (1.8)
金 融 債 券	600,000 (600,000)	600,820 (600,820)	0.5 (0.5)	— (—)	— (—)	0.1 (0.1)	0.4 (0.4)
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	5,600,000 (5,400,000)	5,774,324 (5,566,643)	5.0 (4.8)	— (—)	2.2 (2.1)	2.1 (2.0)	0.8 (0.8)
合 計	103,381,992 (34,415,992)	114,628,033 (37,107,968)	99.5 (32.2)	— (—)	65.9 (19.8)	23.6 (7.6)	10.1 (4.9)

※( )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。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

## 国内債券 (NOMURA-BPI) マザーファンド

### B 個別銘柄開示 国内(邦貨建)公社債

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国債証券	第395回 利付国債(2年)	0.1	600,000	602,826	2020/12/1
	第396回 利付国債(2年)	0.1	500,000	502,495	2021/1/1
	第400回 利付国債(2年)	0.1	570,000	573,511	2021/5/1
	第125回 利付国債(5年)	0.1	20,000	20,078	2020/9/20
	第126回 利付国債(5年)	0.1	340,000	341,659	2020/12/20
	第127回 利付国債(5年)	0.1	1,225,000	1,232,080	2021/3/20
	第128回 利付国債(5年)	0.1	655,000	659,401	2021/6/20
	第129回 利付国債(5年)	0.1	405,000	408,065	2021/9/20
	第130回 利付国債(5年)	0.1	440,000	443,700	2021/12/20
	第131回 利付国債(5年)	0.1	955,000	963,967	2022/3/20
	第132回 利付国債(5年)	0.1	275,000	277,862	2022/6/20
	第133回 利付国債(5年)	0.1	450,000	455,157	2022/9/20
	第134回 利付国債(5年)	0.1	830,000	840,399	2022/12/20
	第135回 利付国債(5年)	0.1	750,000	760,207	2023/3/20
	第136回 利付国債(5年)	0.1	850,000	862,529	2023/6/20
	第137回 利付国債(5年)	0.1	200,000	203,136	2023/9/20
	第138回 利付国債(5年)	0.1	850,000	864,118	2023/12/20
	第139回 利付国債(5年)	0.1	350,000	356,139	2024/3/20
	第2回 利付国債(40年)	2.2	132,000	203,545	2049/3/20
	第3回 利付国債(40年)	2.2	160,000	249,076	2050/3/20
	第4回 利付国債(40年)	2.2	200,000	314,702	2051/3/20
	第5回 利付国債(40年)	2.0	212,000	323,800	2052/3/20
	第6回 利付国債(40年)	1.9	215,000	324,387	2053/3/20
	第7回 利付国債(40年)	1.7	243,000	353,941	2054/3/20
	第8回 利付国債(40年)	1.4	260,000	355,196	2055/3/20
	第9回 利付国債(40年)	0.4	376,000	385,888	2056/3/20
	第10回 利付国債(40年)	0.9	383,000	460,913	2057/3/20
	第11回 利付国債(40年)	0.8	320,000	374,883	2058/3/20
	第12回 利付国債(40年)	0.5	35,000	37,155	2059/3/20
	第312回 利付国債(10年)	1.2	985,000	1,006,098	2020/12/20
	第313回 利付国債(10年)	1.3	1,020,000	1,047,336	2021/3/20
	第315回 利付国債(10年)	1.2	1,165,000	1,198,540	2021/6/20
	第317回 利付国債(10年)	1.1	1,100,000	1,133,077	2021/9/20
	第319回 利付国債(10年)	1.1	590,000	609,717	2021/12/20
	第320回 利付国債(10年)	1.0	575,000	592,773	2021/12/20
	第321回 利付国債(10年)	1.0	395,000	408,477	2022/3/20
	第322回 利付国債(10年)	0.9	460,000	474,425	2022/3/20
	第323回 利付国債(10年)	0.9	295,000	305,150	2022/6/20
	第324回 利付国債(10年)	0.8	545,000	562,107	2022/6/20
	第325回 利付国債(10年)	0.8	345,000	356,805	2022/9/20
	第326回 利付国債(10年)	0.7	620,000	640,788	2022/12/20
	第327回 利付国債(10年)	0.8	570,000	591,118	2022/12/20
	第328回 利付国債(10年)	0.6	900,000	929,097	2023/3/20
	第329回 利付国債(10年)	0.8	850,000	886,388	2023/6/20
	第330回 利付国債(10年)	0.8	560,000	585,502	2023/9/20

## 国内債券（NOMURA-BPI）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
	第332回 利付国債(10年)	0.6	595,000	618,431	2023/12/20
	第333回 利付国債(10年)	0.6	330,000	343,714	2024/3/20
	第334回 利付国債(10年)	0.6	345,000	360,111	2024/6/20
	第335回 利付国債(10年)	0.5	95,000	98,868	2024/9/20
	第336回 利付国債(10年)	0.5	115,000	119,908	2024/12/20
	第337回 利付国債(10年)	0.3	355,000	366,189	2024/12/20
	第338回 利付国債(10年)	0.4	607,000	630,545	2025/3/20
	第339回 利付国債(10年)	0.4	615,000	639,919	2025/6/20
	第340回 利付国債(10年)	0.4	883,000	920,306	2025/9/20
	第341回 利付国債(10年)	0.3	615,000	637,976	2025/12/20
	第342回 利付国債(10年)	0.1	960,000	984,057	2026/3/20
	第343回 利付国債(10年)	0.1	1,057,000	1,084,503	2026/6/20
	第344回 利付国債(10年)	0.1	970,000	996,160	2026/9/20
	第345回 利付国債(10年)	0.1	945,000	971,015	2026/12/20
	第346回 利付国債(10年)	0.1	640,000	657,945	2027/3/20
	第347回 利付国債(10年)	0.1	955,000	981,873	2027/6/20
	第348回 利付国債(10年)	0.1	595,000	611,767	2027/9/20
	第349回 利付国債(10年)	0.1	635,000	652,875	2027/12/20
	第350回 利付国債(10年)	0.1	765,000	786,473	2028/3/20
	第351回 利付国債(10年)	0.1	720,000	740,124	2028/6/20
	第352回 利付国債(10年)	0.1	905,000	929,706	2028/9/20
	第353回 利付国債(10年)	0.1	920,000	944,886	2028/12/20
	第354回 利付国債(10年)	0.1	910,000	934,342	2029/3/20
	第2回 利付国債(30年)	2.4	150,000	190,953	2030/2/20
	第4回 利付国債(30年)	2.9	160,000	215,307	2030/11/20
	第5回 利付国債(30年)	2.2	100,000	127,421	2031/5/20
	第7回 利付国債(30年)	2.3	180,000	234,973	2032/5/20
	第10回 利付国債(30年)	1.1	230,000	265,505	2033/3/20
	第11回 利付国債(30年)	1.7	150,000	186,082	2033/6/20
	第12回 利付国債(30年)	2.1	230,000	299,036	2033/9/20
	第14回 利付国債(30年)	2.4	220,000	297,195	2034/3/20
	第15回 利付国債(30年)	2.5	250,000	342,702	2034/6/20
	第16回 利付国債(30年)	2.5	175,000	240,614	2034/9/20
	第18回 利付国債(30年)	2.3	190,000	256,783	2035/3/20
	第19回 利付国債(30年)	2.3	160,000	216,960	2035/6/20
	第21回 利付国債(30年)	2.3	102,000	139,098	2035/12/20
	第22回 利付国債(30年)	2.5	149,000	208,580	2036/3/20
	第23回 利付国債(30年)	2.5	151,000	212,099	2036/6/20
	第24回 利付国債(30年)	2.5	135,000	190,100	2036/9/20
	第25回 利付国債(30年)	2.3	185,000	254,992	2036/12/20
	第26回 利付国債(30年)	2.4	219,000	306,556	2037/3/20
	第27回 利付国債(30年)	2.5	206,000	293,554	2037/9/20
	第28回 利付国債(30年)	2.5	271,000	388,529	2038/3/20
	第29回 利付国債(30年)	2.4	170,000	241,787	2038/9/20
	第30回 利付国債(30年)	2.3	270,000	380,956	2039/3/20
	第31回 利付国債(30年)	2.2	277,000	387,833	2039/9/20
	第32回 利付国債(30年)	2.3	347,000	495,602	2040/3/20
	第33回 利付国債(30年)	2.0	380,000	522,078	2040/9/20
	第34回 利付国債(30年)	2.2	359,000	511,284	2041/3/20

国内債券（NOMURA-BPI）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
	第35回 利付国債(30年)	2.0	430,000	596,779	2041/9/20
	第36回 利付国債(30年)	2.0	225,000	313,791	2042/3/20
	第37回 利付国債(30年)	1.9	375,000	517,200	2042/9/20
	第38回 利付国債(30年)	1.8	330,000	449,687	2043/3/20
	第39回 利付国債(30年)	1.9	155,000	215,336	2043/6/20
	第40回 利付国債(30年)	1.8	285,000	390,011	2043/9/20
	第41回 利付国債(30年)	1.7	240,000	323,318	2043/12/20
	第42回 利付国債(30年)	1.7	230,000	310,612	2044/3/20
	第43回 利付国債(30年)	1.7	220,000	297,853	2044/6/20
	第44回 利付国債(30年)	1.7	267,000	361,955	2044/9/20
	第45回 利付国債(30年)	1.5	272,000	356,058	2044/12/20
	第46回 利付国債(30年)	1.5	335,000	439,476	2045/3/20
	第47回 利付国債(30年)	1.6	285,000	381,714	2045/6/20
	第48回 利付国債(30年)	1.4	305,000	393,337	2045/9/20
	第49回 利付国債(30年)	1.4	305,000	394,127	2045/12/20
	第50回 利付国債(30年)	0.8	340,000	386,875	2046/3/20
	第51回 利付国債(30年)	0.3	297,000	299,616	2046/6/20
	第52回 利付国債(30年)	0.5	307,000	325,334	2046/9/20
	第53回 利付国債(30年)	0.6	282,000	306,212	2046/12/20
	第54回 利付国債(30年)	0.8	120,000	136,768	2047/3/20
	第55回 利付国債(30年)	0.8	260,000	296,251	2047/6/20
	第56回 利付国債(30年)	0.8	325,000	370,695	2047/9/20
	第57回 利付国債(30年)	0.8	295,000	336,373	2047/12/20
	第58回 利付国債(30年)	0.8	560,000	639,167	2048/3/20
	第59回 利付国債(30年)	0.7	280,000	311,956	2048/6/20
	第60回 利付国債(30年)	0.9	330,000	386,357	2048/9/20
	第61回 利付国債(30年)	0.7	360,000	401,198	2048/12/20
	第62回 利付国債(30年)	0.5	80,000	84,600	2049/3/20
	第48回 利付国債(20年)	2.5	368,000	383,106	2020/12/21
	第50回 利付国債(20年)	1.9	223,000	231,349	2021/3/22
	第52回 利付国債(20年)	2.1	210,000	221,075	2021/9/21
	第54回 利付国債(20年)	2.2	275,000	291,791	2021/12/20
	第56回 利付国債(20年)	2.0	320,000	341,638	2022/6/20
	第58回 利付国債(20年)	1.9	300,000	321,234	2022/9/20
	第59回 利付国債(20年)	1.7	280,000	299,269	2022/12/20
	第61回 利付国債(20年)	1.0	140,000	146,643	2023/3/20
	第63回 利付国債(20年)	1.8	156,000	168,912	2023/6/20
	第64回 利付国債(20年)	1.9	210,000	229,391	2023/9/20
	第65回 利付国債(20年)	1.9	370,000	406,285	2023/12/20
	第69回 利付国債(20年)	2.1	200,000	222,622	2024/3/20
	第70回 利付国債(20年)	2.4	380,000	431,064	2024/6/20
	第72回 利付国債(20年)	2.1	300,000	337,587	2024/9/20
	第74回 利付国債(20年)	2.1	278,000	314,509	2024/12/20
	第75回 利付国債(20年)	2.1	230,000	261,581	2025/3/20
	第78回 利付国債(20年)	1.9	340,000	384,621	2025/6/20
	第82回 利付国債(20年)	2.1	288,000	331,070	2025/9/20
	第84回 利付国債(20年)	2.0	424,000	487,180	2025/12/20
	第85回 利付国債(20年)	2.1	332,000	385,528	2026/3/20
	第88回 利付国債(20年)	2.3	329,000	388,746	2026/6/20

## 国内債券（NOMURA-BPI）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
	第90回 利付国債(20年)	2.2	418,000	493,607	2026/9/20
	第92回 利付国債(20年)	2.1	295,000	347,843	2026/12/20
	第93回 利付国債(20年)	2.0	242,000	284,778	2027/3/20
	第95回 利付国債(20年)	2.3	186,000	224,338	2027/6/20
	第97回 利付国債(20年)	2.2	400,000	481,328	2027/9/20
	第99回 利付国債(20年)	2.1	337,000	404,359	2027/12/20
	第100回 利付国債(20年)	2.2	310,000	376,222	2028/3/20
	第102回 利付国債(20年)	2.4	285,000	352,567	2028/6/20
	第105回 利付国債(20年)	2.1	337,000	409,077	2028/9/20
	第107回 利付国債(20年)	2.1	418,000	509,604	2028/12/20
	第109回 利付国債(20年)	1.9	315,000	379,237	2029/3/20
	第111回 利付国債(20年)	2.2	393,000	486,734	2029/6/20
	第113回 利付国債(20年)	2.1	395,000	487,003	2029/9/20
	第114回 利付国債(20年)	2.1	323,000	399,664	2029/12/20
	第116回 利付国債(20年)	2.2	320,000	401,030	2030/3/20
	第118回 利付国債(20年)	2.0	245,000	302,714	2030/6/20
	第119回 利付国債(20年)	1.8	210,000	254,790	2030/6/20
	第121回 利付国債(20年)	1.9	200,000	245,648	2030/9/20
	第122回 利付国債(20年)	1.8	225,000	273,793	2030/9/20
	第123回 利付国債(20年)	2.1	205,000	257,311	2030/12/20
	第124回 利付国債(20年)	2.0	240,000	298,452	2030/12/20
	第125回 利付国債(20年)	2.2	155,000	197,133	2031/3/20
	第126回 利付国債(20年)	2.0	185,000	230,896	2031/3/20
	第127回 利付国債(20年)	1.9	190,000	234,881	2031/3/20
	第128回 利付国債(20年)	1.9	240,000	297,561	2031/6/20
	第129回 利付国債(20年)	1.8	210,000	257,823	2031/6/20
	第130回 利付国債(20年)	1.8	360,000	443,174	2031/9/20
	第131回 利付国債(20年)	1.7	225,000	274,203	2031/9/20
	第132回 利付国債(20年)	1.7	270,000	330,048	2031/12/20
	第133回 利付国債(20年)	1.8	205,000	253,175	2031/12/20
	第134回 利付国債(20年)	1.8	163,000	201,808	2032/3/20
	第135回 利付国債(20年)	1.7	165,000	202,166	2032/3/20
	第136回 利付国債(20年)	1.6	205,000	248,546	2032/3/20
	第137回 利付国債(20年)	1.7	130,000	159,760	2032/6/20
	第138回 利付国債(20年)	1.5	150,000	180,415	2032/6/20
	第139回 利付国債(20年)	1.6	160,000	194,536	2032/6/20
	第140回 利付国債(20年)	1.7	540,000	665,150	2032/9/20
	第141回 利付国債(20年)	1.7	190,000	234,549	2032/12/20
	第142回 利付国債(20年)	1.8	190,000	237,123	2032/12/20
	第143回 利付国債(20年)	1.6	200,000	244,656	2033/3/20
	第144回 利付国債(20年)	1.5	355,000	429,372	2033/3/20
	第145回 利付国債(20年)	1.7	322,000	399,457	2033/6/20
	第146回 利付国債(20年)	1.7	330,000	410,229	2033/9/20
	第147回 利付国債(20年)	1.6	530,000	652,472	2033/12/20
	第148回 利付国債(20年)	1.5	472,000	575,122	2034/3/20
	第149回 利付国債(20年)	1.5	277,000	338,297	2034/6/20
	第150回 利付国債(20年)	1.4	485,000	585,860	2034/9/20
	第151回 利付国債(20年)	1.2	595,000	701,308	2034/12/20
	第152回 利付国債(20年)	1.2	400,000	471,860	2035/3/20

国内債券（NOMURA-BPI）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
	第153回 利付国債(20年)	1.3	332,000	397,543	2035/6/20
	第154回 利付国債(20年)	1.2	515,000	608,987	2035/9/20
	第155回 利付国債(20年)	1.0	310,000	356,729	2035/12/20
	第156回 利付国債(20年)	0.4	480,000	504,542	2036/3/20
	第157回 利付国債(20年)	0.2	423,000	430,068	2036/6/20
	第158回 利付国債(20年)	0.5	455,000	485,448	2036/9/20
	第159回 利付国債(20年)	0.6	363,000	393,535	2036/12/20
	第160回 利付国債(20年)	0.7	435,000	479,252	2037/3/20
	第161回 利付国債(20年)	0.6	475,000	514,710	2037/6/20
	第162回 利付国債(20年)	0.6	415,000	449,366	2037/9/20
	第163回 利付国債(20年)	0.6	475,000	513,935	2037/12/20
	第164回 利付国債(20年)	0.5	435,000	462,757	2038/3/20
	第165回 利付国債(20年)	0.5	340,000	361,311	2038/6/20
	第166回 利付国債(20年)	0.7	440,000	484,369	2038/9/20
	第167回 利付国債(20年)	0.5	555,000	589,565	2038/12/20
	第168回 利付国債(20年)	0.4	305,000	318,096	2039/3/20
	小 計	—	79,723,000	89,776,323	—
地方債証券	第1回 東京都公募公債(20年)	1.54	200,000	212,400	2023/6/20
	第7回 東京都公募公債(20年)	2.16	100,000	113,557	2025/9/19
	第8回 東京都公募公債(30年)	2.23	100,000	135,400	2038/9/17
	第13回 東京都公募公債(30年)	1.93	200,000	267,194	2042/3/19
	第681回 東京都公募公債	1.4	200,000	202,106	2020/3/19
	平成21年度第16回 北海道公募公債	1.44	100,000	101,094	2020/3/25
	平成26年度第13回 北海道公募公債	0.461	100,000	102,514	2024/12/26
	平成29年度第5回 北海道公募公債	0.18	100,000	101,411	2027/6/30
	平成29年度第6回 北海道公募公債(5年)	0.01	200,000	199,972	2022/7/28
	第7回 神奈川県公募公債(20年)	2.22	200,000	234,290	2027/3/19
	第192回 神奈川県公募公債	0.805	100,000	102,635	2022/9/20
	第147回 大阪府公募公債(5年)	0.001	100,000	100,022	2023/2/27
	第333回 大阪府公募公債(10年)	1.47	100,000	100,746	2019/12/25
	第337回 大阪府公募公債(10年)	1.44	100,000	101,242	2020/4/28
	第361回 大阪府公募公債(10年)	0.92	100,000	102,795	2022/6/28
	第395回 大阪府公募公債(10年)	0.435	200,000	205,038	2025/4/28
	平成27年度第11回 京都府公募公債	0.469	200,000	206,300	2025/12/18
	平成30年度第6回 京都府公募公債	0.03	200,000	200,386	2023/9/20
	第5回 兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	111,685	2028/5/26
	第9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	122,928	2029/11/19
	平成21年度第25回 兵庫県公募公債	1.54	200,000	201,292	2019/11/20
	平成22年度第1回 兵庫県公募公債	1.46	100,000	101,212	2020/4/16
	第7回 静岡県公募公債(30年)	1.988	100,000	136,135	2043/6/19
	平成20年度第1回 静岡県公募公債	2.18	100,000	113,719	2025/9/19
	平成21年度第10回 静岡県公募公債	1.4	100,000	101,050	2020/3/18
	平成26年度第10回 静岡県公募公債	0.515	100,000	102,879	2024/11/25
	平成21年度第8回 愛知県公募公債(10年)	1.39	100,000	100,388	2019/9/30
	平成26年度第14回 愛知県公募公債(10年)	0.535	100,000	102,992	2024/11/28
	平成26年度第18回 愛知県公募公債(10年)	0.44	100,000	102,629	2025/3/27
	平成29年度第16回 愛知県公募公債(10年)	0.26	100,000	102,204	2028/2/14
	平成26年度第1回 広島県公募公債	0.67	100,000	103,380	2024/5/27
	第13回 埼玉県公募公債(20年)	1.599	100,000	119,996	2033/5/20

## 国内債券（NOMURA-BPI）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
	平成26年度第4回 埼玉県公募公債	0.654	100,000	103,356	2024/6/26
	平成27年度第2回 埼玉県公募公債(5年)	0.137	100,000	100,121	2020/4/16
	平成29年度第2回 埼玉県公募公債(5年)	0.01	200,000	200,086	2022/4/19
	平成25年度第11回 福岡県公募公債	0.694	100,000	103,324	2024/2/26
	平成26年度第5回 福岡県公募公債	0.525	200,000	205,784	2024/10/28
	平成21年度第11回 千葉県公募公債	1.42	200,000	201,698	2020/1/24
	平成26年度第3回 千葉県公募公債	0.611	300,000	309,570	2024/7/25
	平成26年度第5回 千葉県公募公債	0.476	200,000	205,416	2024/12/25
	令和元年度第2回 千葉県公募公債	0.01	100,000	100,123	2024/5/24
	第11回 群馬県公募公債(10年)	0.505	100,000	102,825	2024/11/25
	第79回 共同発行市場公募地方債	1.34	200,000	200,934	2019/10/25
	第82回 共同発行市場公募地方債	1.42	200,000	201,698	2020/1/24
	第84回 共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	101,061	2020/3/25
	第91回 共同発行市場公募地方債	0.9	300,000	303,666	2020/10/23
	第115回 共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	308,088	2022/10/25
	第137回 共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	103,007	2024/8/23
	第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,825	2024/11/25
	第149回 共同発行市場公募地方債	0.5	100,000	103,183	2025/8/25
	第154回 共同発行市場公募地方債	0.405	150,000	153,958	2026/1/23
	第175回 共同発行市場公募地方債	0.215	200,000	203,512	2027/10/25
	平成23年度第4回 京都市公募公債	1.067	100,000	102,685	2021/12/22
	第16回 横浜市公募公債(20年)	2.35	100,000	121,681	2028/9/21
	平成27年度第5回 福岡市公募公債	0.476	100,000	103,124	2025/10/28
	平成27年度第7回 福岡市公募公債(5年)	0.101	100,000	100,169	2020/12/24
	平成29年度第11回 福岡市公募公債(5年)	0.04	300,000	300,504	2023/3/16
	小 計	-	8,150,000	8,553,989	-
特 殊 債 券 (除く金融債)	第14回 政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.199	200,000	200,536	2020/6/18
	第1回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	12,628	12,921	2036/5/10
	第1回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	14,910	15,660	2037/11/10
	第2回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.61	12,909	13,254	2036/5/10
	第5回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	13,270	13,676	2036/11/10
	第9回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	9,983	10,015	2037/12/10
	第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	14,364	15,084	2037/5/10
	第10回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	10,719	10,805	2038/2/10
	第10回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	14,847	15,603	2037/5/10
	第12回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	11,515	11,720	2038/9/10
	第14回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7	15,674	16,017	2032/5/10
	第18回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.89	11,447	11,673	2039/5/10
	第29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	30,552	33,122	2044/10/10
	第30回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	13,125	13,484	2040/5/10
	第32回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	15,594	16,221	2040/7/10
	第32回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	29,777	31,995	2045/1/10
	第35回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	16,500	17,282	2040/10/10
	第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	15,476	16,221	2040/12/10
	第37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	32,756	34,930	2045/6/10
	第40回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	16,940	17,946	2041/3/10
	第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	14,639	15,431	2041/5/10
	第48回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.33	14,625	15,468	2041/11/10
	第49回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	33,082	35,368	2046/6/10

# 国内債券（NOMURA-BPI）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
第51回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	36,453	38,942	2046/8/10
第55回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	47,650	50,766	2046/12/10
第57回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	45,359	48,339	2047/2/10
第59回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	46,450	49,545	2047/4/10
第67回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	52,593	55,339	2047/12/10
第69回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	53,577	56,877	2048/2/10
第70回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	47,351	50,046	2048/3/10
第73回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	53,090	56,478	2048/6/10
第88回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.93	57,683	60,278	2049/9/10
第113回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	88,871	90,355	2051/10/10
第123回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	92,621	94,727	2052/8/10
第124回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	92,787	94,669	2052/9/10
第125回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	93,091	95,013	2052/10/10
第130回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	100,000	121,581	2032/12/20
第132回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	95,483	97,344	2053/5/10
第138回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	98,028	100,721	2053/11/10
第146回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	100,000	100,292	2054/7/10
第2回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	15,876	16,728	2042/6/10
第3回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	15,697	16,566	2037/11/10
第27回	道路債券	2.42	100,000	111,488	2024/3/20
第32回	道路債券	2.44	100,000	112,542	2024/9/20
第42回	道路債券	2.22	100,000	112,505	2025/3/21
第12回	地方公共団体金融機構債券	1.38	100,000	101,306	2020/5/28
第61回	地方公共団体金融機構債券	0.69	100,000	103,333	2024/6/28
第9回	政府保証日本政策投資銀行社債	1.0	101,000	102,336	2020/9/14
第15回	政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	100,000	105,184	2021/12/22
第22回	政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	109,095	2023/6/19
第29回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.165	300,000	301,413	2021/6/22
第34回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.001	500,000	501,005	2022/6/30
第42回	政府保証日本政策投資銀行社債	0.155	100,000	101,745	2027/12/15
第6回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	206,656	2021/2/26
第79回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	121,074	2029/4/27
第92回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	122,145	2029/10/31
第99回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	123,588	2030/1/31
第100回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	101,017	2020/2/28
第104回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	200,000	202,538	2020/4/30
第112回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	100,000	101,302	2020/7/31
第120回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	101,322	2020/10/30
第173回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.819	300,000	308,721	2022/9/30
第207回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.693	200,000	206,974	2023/12/28
第209回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.747	100,000	103,808	2024/1/31
第220回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	300,000	310,788	2024/6/28
第221回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.466	100,000	119,625	2024/6/30
第227回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.544	300,000	309,753	2024/9/30
第246回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.178	100,000	116,022	2035/5/31
第333回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.155	100,000	101,752	2027/12/28
第339回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	100,000	102,136	2028/2/29
第203回	政府保証預金保険機構債	0.1	200,000	200,188	2020/1/17
第208回	政府保証預金保険機構債	0.1	400,000	400,880	2020/10/6

## 国内債券（NOMURA-BPI）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
	第66回 日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位)	0.09	100,000	100,240	2026/4/17
	第4回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.59	100,000	137,797	2035/12/20
	第22回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	200,000	314,208	2047/3/20
	第37回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	121,544	2028/6/20
	第122回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.704	200,000	206,824	2024/3/19
	第1回 政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.576	200,000	202,904	2021/9/24
	第4回 公営企業債券(20年)	2.09	200,000	217,906	2023/9/20
	第9回 地方公共団体金融機構債券	1.476	200,000	202,054	2020/2/28
	第16回 地方公共団体金融機構債券(5年)	0.175	100,000	100,059	2019/10/28
	第18回 公営企業債券(20年)	2.58	100,000	117,676	2026/6/19
	第22回 公営企業債券(20年)	2.32	200,000	236,606	2027/6/18
	第39回 地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	102,611	2022/8/26
	第48回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.121	100,000	114,098	2035/12/28
	第59回 地方公共団体金融機構債券(10年)	0.724	100,000	103,583	2024/4/26
	第62回 地方公共団体金融機構債券	0.631	300,000	309,252	2024/7/26
	第281回 地方公共団体金融機構債券	0.999	100,000	111,639	2033/9/21
	第6回 独立行政法人福祉医療機構債券	2.11	100,000	112,024	2025/3/19
	第190回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.08	100,000	100,251	2026/6/19
	小 計	-	9,308,992	9,922,576	-
金 融 債 券	い第776号 商工債	0.17	100,000	100,099	2020/1/27
	第298回 信金中金債(5年)	0.2	200,000	200,096	2019/9/27
	第304回 信金中金債(5年)	0.225	200,000	200,370	2020/3/27
	第350回 信金中金債(5年)	0.08	100,000	100,255	2024/1/26
	小 計	-	600,000	600,820	-
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第499回 中部電力	1.194	100,000	104,325	2023/6/23
	第507回 中部電力	0.605	100,000	102,973	2026/1/23
	第527回 関西電力	0.28	200,000	201,202	2024/4/25
	第476回 東北電力	0.57	100,000	102,275	2025/1/24
	第508回 東北電力	0.465	200,000	203,254	2029/4/25
	第253回 四国電力	1.0	100,000	103,633	2023/6/23
	第328回 北海道電力	0.42	100,000	100,894	2023/1/25
	第13回 大和ハウス工業	0.285	100,000	101,058	2027/6/1
	第10回 アサヒグループホールディングス	0.17	100,000	100,252	2022/6/13
	第30回 東レ	0.375	100,000	101,358	2027/7/16
	第7回 クラレ	0.19	100,000	100,653	2025/4/25
	第56回 住友化学	0.38	100,000	101,334	2027/9/13
	第47回 三井化学	0.26	100,000	100,609	2025/6/19
	第24回 三菱ケミカルホールディングス	0.37	100,000	101,540	2028/2/25
	第11回 プリチストン	0.295	200,000	201,850	2027/4/21
	第3回 新日鐵住金	0.22	100,000	100,493	2024/5/20
	第7回 ジェイテクト	0.345	100,000	101,115	2028/3/8
	第12回 パナソニック	0.387	100,000	100,255	2020/3/19
	第13回 パナソニック	0.568	100,000	101,361	2022/3/18
	第1回 明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債	0.51	100,000	100,031	2019/8/7
	第1回 ユニー・ファミリーマートホールディングス	0.14	100,000	100,319	2022/2/22
	第51回 住友商事	1.241	100,000	109,311	2029/4/23
	第69回 クレディセゾン	0.18	100,000	100,182	2023/6/19
	第25回 三菱東京UFJ銀行	1.31	100,000	101,717	2020/11/12
	第57回 東京三菱銀行	2.22	100,000	107,211	2022/10/27

## 国内債券（NOMURA-BPI）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
	第1回 三井住友フィナンシャル	0.849	100,000	102,701	2024/9/12
	第9回 三菱UFJ信託銀行	1.68	100,000	102,901	2021/4/28
	第1回 みずほフィナンシャルグループ	0.95	100,000	102,867	2024/7/16
	第20回 三井住友銀行	2.21	100,000	100,195	2019/7/24
	第49回 日産フィナンシャルサービス	0.2	200,000	199,670	2023/3/20
	第1回 野村ホールディングス	0.3	100,000	100,358	2023/9/4
	第65回 三菱地所	2.04	100,000	122,480	2032/12/20
	第73回 東京急行電鉄	1.422	100,000	102,116	2020/12/16
	第38回 京王電鉄	0.295	100,000	101,717	2027/11/29
	第24回 東日本旅客鉄道	1.71	100,000	105,529	2022/9/20
	第32回 東日本旅客鉄道	2.26	100,000	110,483	2024/3/19
	第69回 東日本旅客鉄道	1.222	100,000	101,329	2020/7/22
	第126回 東日本旅客鉄道	0.275	200,000	203,156	2028/1/26
	第10回 西日本旅客鉄道	2.04	100,000	108,557	2023/9/20
	第13回 西日本旅客鉄道	2.34	100,000	116,863	2027/2/19
	第7回 東海旅客鉄道	2.2	100,000	106,323	2022/5/10
	第13回 東海旅客鉄道	2.015	100,000	108,899	2023/12/20
	第32回 東海旅客鉄道	2.31	100,000	117,678	2027/9/17
	第63回 日本電信電話	0.69	100,000	102,623	2023/3/20
	第27回 KDDI	0.23	100,000	100,636	2026/4/24
	第38回 電源開発	0.978	100,000	103,636	2023/12/20
	第24回 東京電力パワーグリッド	0.61	100,000	100,787	2024/4/24
	第19回 大阪瓦斯	1.83	100,000	101,321	2020/3/19
	第7回 ファーストリテイリング	0.405	100,000	101,496	2028/6/6
	第2回 ビー・ビー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20	0.645	100,000	100,494	2023/7/12
	第11回 ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.3	100,000	100,304	2021/1/22
	小 計	—	5,600,000	5,774,324	—
	合 計	—	103,381,992	114,628,033	—

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ■ 投資信託財産の構成

(2019年6月20日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 114,628,033	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,018,011	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	115,646,044	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## 国内債券（NOMURA-BPI）マザーファンド

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年6月20日現在)

項 目	期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>115,646,044,557円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	643,152,553
公 社 債 ( 評 価 額 )	114,628,033,462
未 収 入 金	203,016,000
未 収 利 息	168,365,591
前 払 費 用	3,476,951
<b>(B) 負 債</b>	<b>446,299,321</b>
未 払 金	380,113,300
未 払 解 約 金	66,171,967
未 払 利 息	1,373
そ の 他 未 払 費 用	12,681
<b>(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )</b>	<b>115,199,745,236</b>
元 本	80,135,880,996
次 期 繰 越 損 益 金	35,063,864,240
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>80,135,880,996口</b>
<b>1 万 口 当 た り 基 準 価 額 ( C / D )</b>	<b>14,376円</b>

※当期における期首元本額77,206,605,986円、期中追加設定元本額14,411,029,736円、期中一部解約元本額11,481,754,726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・日本債券インデックス・ファンド	51,358,555,093円
SMAM・国内債券インデックス・ファンド	6,464,912,583円
国内債券インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	183,803,285円
SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	22,128,610,035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>

委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
(適用日：2019年4月1日)

### ■ 損益の状況

(自2018年6月21日 至2019年6月20日)

項 目	当 期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>1,063,086,913円</b>
受 取 利 息	1,063,468,235
支 払 利 息	△ 381,322
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>2,196,854,630</b>
売 買 損 益	2,566,114,512
売 買 損 益	△ 369,259,882
<b>(C) 信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 370,473</b>
<b>(D) 当 期 損 益 金 ( A + B + C )</b>	<b>3,259,571,070</b>
<b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>30,535,280,643</b>
<b>(F) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>5,827,965,696</b>
<b>(G) 解 約 差 損 益 金</b>	<b>△ 4,558,953,169</b>
<b>(H) 計 ( D + E + F + G )</b>	<b>35,063,864,240</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 ( H )</b>	<b>35,063,864,240</b>

※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。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※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。

※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。

# SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

第 19 期

決算日 2019年12月2日

## ■当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2001年4月6日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、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。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 外国株式インデックス・マザーファンド 日本を除く世界各国の株式
当ファンドの運用方法	■主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。 ■外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 外国株式インデックス・マザーファンド ■株式への投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	年1回（毎年11月30日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、以下の方針に基づき収益分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

■ 1万口当たりの費用明細(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	23円 (3) (3) (17)	0.083% (0.011) (0.011) (0.061)	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) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料 (株式) (投資信託証券) (先物・オプション)	2 (1) (0) (0)	0.006 (0.004) (0.000) (0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	4 (4) (0)	0.014 (0.013) (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
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	15 (11) (3) (1)	0.056 (0.041) (0.011) (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入金・資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	44	0.159	

期中の平均基準価額は27,442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。

※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。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インテックス・マザーファンド	110,197	369,400	824,365	2,932,428

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ■ 組入れ資産の明細 (2019年12月2日現在)

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)		期 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
外国株式インデックス・マザーファンド	千口 2, 124, 666	千口 1, 410, 498	千口 5, 474, 567	千円

※外国株式インデックス・マザーファンドの期末の受益権総口数は59,882,488千口です。  
※単位未満は切捨て。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月2日現在)

項 目	期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>5, 525, 934, 808円</b>
コール・ローン等	5, 357, 359
外国株式インデックス・マザーファンド(評価額)	5, 474, 567, 459
未 収 入 金	46, 009, 990
<b>(B) 負 債</b>	<b>48, 726, 497</b>
未 払 解 約 金	46, 009, 990
未 払 信 託 報 酬	2, 382, 516
未 払 利 息	10
そ の 他 未 払 費 用	333, 981
<b>(C) 純 資 産 総 額 (A - B)</b>	<b>5, 477, 208, 311</b>
元 本	1, 823, 431, 400
次 期 繰 越 損 益 金	3, 653, 776, 911
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>1, 823, 431, 400口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>30, 038円</b>

※当期における期首元本額2,743,356,764円、期中追加設定元本額172,535,022円、期中一部解約元本額1,092,460,386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2018年12月1日 至2019年12月2日)

項 目	当 期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>12, 522円</b>
そ の 他 収 益 金	15, 522
支 払 利 息	△ 3, 000
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>586, 532, 849</b>
売 買 損 益	711, 762, 298
売 買 損 益	△ 125, 229, 449
<b>(C) 信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 5, 707, 303</b>
<b>(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)</b>	<b>580, 838, 068</b>
<b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>2, 619, 306, 630</b>
<b>(F) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>453, 632, 213</b>
( 配 当 等 相 当 額 )	( 1, 350, 163, 597)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 896, 531, 384)
<b>(G) 計 (D + E + F)</b>	<b>3, 653, 776, 911</b>
<b>(H) 収 益 分 配 金</b>	<b>0</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)</b>	<b>3, 653, 776, 911</b>
追 加 信 託 差 損 益 金	453, 632, 213
( 配 当 等 相 当 額 )	( 1, 350, 764, 906)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 897, 132, 693)
分 配 準 備 積 立 金	3, 200, 144, 698

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※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。

※期末における、費用控除後の配当等収益(111,701,280円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(469,136,788円)、信託約款に規定される収益調整金(1,350,764,906円)および分配準備積立金(2,619,306,630円)より分配可能額は4,550,909,604円(1万口当たり24,957円)ですが、分配は行っておりません。

# 外国株式インデックス・マザーファンド

第17期（2018年12月1日から2019年12月2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、原則として対円で為替ヘッジを行わないものとします。</li> </ul>

## ■ 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 (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 組入比率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率				
13期 (2015年11月30日)	円	%		%	%	%	%	百万円
14期 (2016年11月30日)	29,051	2.5	299.80	2.6	93.7	3.9	2.3	174,039
15期 (2017年11月30日)	27,558	△ 5.1	284.85	△ 5.0	95.6	2.0	2.4	165,583
16期 (2018年11月30日)	33,807	22.7	350.45	23.0	95.2	2.5	2.3	196,182
17期 (2019年12月2日)	34,678	2.6	360.38	2.8	93.7	3.9	2.3	174,245
	38,813	11.9	404.43	12.2	95.2	2.1	2.7	232,418

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）は、前日の指数を当日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、設定時を100として2019年12月2日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

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

## ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)		株式組入率 比	株式先物率 比 (買建-売建)	投資信託 証券 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2018年11月30日	円	%		%	%	%	%
12月末	34,678	—	360.38	—	93.7	3.9	2.3
2019年1月末	31,058	△10.4	322.64	△10.5	93.8	4.3	2.4
2月末	33,076	△ 4.6	343.47	△ 4.7	94.9	2.7	2.4
3月末	35,061	1.1	364.78	1.2	96.3	1.3	2.4
4月末	35,307	1.8	367.43	2.0	94.8	2.7	2.4
5月末	36,886	6.4	384.07	6.6	96.5	1.0	2.4
6月末	34,561	△ 0.3	359.86	△ 0.1	95.6	1.9	2.5
7月末	35,808	3.3	372.93	3.5	96.5	1.1	2.5
8月末	36,786	6.1	383.06	6.3	96.2	1.2	2.5
9月末	34,963	0.8	364.33	1.1	94.4	3.0	2.6
10月末	36,096	4.1	376.07	4.4	94.7	2.6	2.7
11月末	37,532	8.2	390.60	8.4	94.2	3.1	2.6
(期末) 2019年12月2日	38,931	12.3	405.57	12.5	95.2	2.2	2.6
	38,813	11.9	404.43	12.2	95.2	2.1	2.7

※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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

### 基準価額等の推移



期首	34,678円
期末	38,813円
騰落率	+11.9%

※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。

※MSCIコクサイインデックス（配当込み）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（2018年12月1日から2019年12月2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

- ・米中貿易交渉の進展期待や先進国の緩和的な金融政策を背景に、株式市場が上昇したこと

### 下落要因

- ・米ドル、ユーロが対円で下落したこと

### ▶ 投資環境について（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

当期の世界の株式市場は上昇しました。為替市場では、米ドル、ユーロともに対円で下落しました。

#### 株式市場

世界の株式市場は、期初から2018年12月下旬まで下落しました。米中貿易摩擦問題がくすぶる中、12月上旬に行われた米中首脳会談の後に二国間の問題解決への期待が後退したことが下押し材料になりました。また、中国景気の減速や関税率引上げの影響で、堅調だった米国の企業業績についても懸念が高まりました。また、フランスにおける反政府デモ、英国のEU（欧州連合）離脱問題など、EU域内の不安定な政治動向も嫌気されました。年明けから4月にかけては、株式市場の下落に呼応して米国や中国で政策対応への期待が高まったことや、FRB（米連邦準備制度理事会）が利上げを停止し、景気動向や市場動向に配慮する姿勢に転換したことを好感し、上昇しました。5月は、トランプ米大統領が対中輸入関税率の追加引上げを指示したことから再び米中貿易摩擦問題の深刻化に対する懸念が高まり、株価が下落しました。6月から7月後半にかけては、堅調な企業決算発表を受けて企業業績に対する悲観的な見方が後退したことなどから、株価が再度上昇に転じました。8月には米国が中国に対する新たな追加関税の導入を発表し、株価が下落しましたが、9月以降は米中貿易交渉の再開を受け、貿易摩擦問題の進展期待が高まり、あわせて欧米主要国の中銀による緩和的な金融政策を受け期末にかけて値を戻す展開となりました。

FRBは7月以降3回の利下げを実施しました。またECB（欧州中央銀行）は9月に再び金融緩和に舵を切りました。米中貿易交渉については、10月に第一段階の合意の大枠が発表され、その後の株価の下支えになりました。

当期のMSCIコクサイインデックス（配当込み、米ドルベース）は、期首に比べて16.1%上昇しました。

#### 為替市場

米ドル・円相場は、期初から2019年1月初にかけて、株価の下落などを受け、急激な米ドル安・円高となりました。1月上旬から4月末にかけては、緩やかな米ドル高・円安基調での推移となりました。FRBが利上げを停止したことや、堅調な景気指標が発表されたことなどが要因

です。5月から8月にかけては、中国に対する関税の引上げや新たな追加関税の導入が発表されるなど再び米中の貿易摩擦への懸念が高まったことや、米国の金融緩和期待が高まったことなどを受け、安全資産とされる円が上昇しました。9月から期末にかけては、米中通商協議に対する期待などから円は米ドルに対し下落しました。

ユーロは、対円で下落しました。概ね米ドル・円相場と同様の動きとなりましたが、欧州域内の景気減速懸念の高まりや、英国のEUからの強硬離脱懸念といった域内情勢の不安定化など、通貨ユーロを取り巻く不安材料が払拭されず、戻りは限定的でした。

当期の米ドル・円は期首113円47銭から期末109円68銭へと3円79銭の米ドル安・円高、ユーロ・円は期首129円19銭から期末120円86銭へと8円33銭のユーロ安・円高となりました。

---

### ▶ ポートフォリオについて (2018年12月1日から2019年12月2日まで)

---

#### 株式組入比率

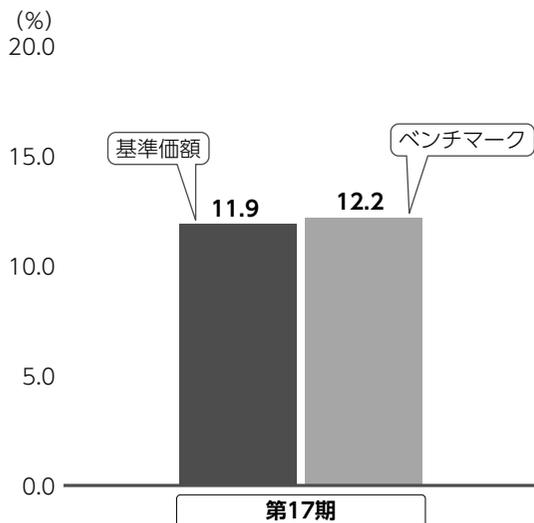
MSC I コクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、株式組入比率は期を通じて概ね100%（投資信託証券、先物含む）を維持しました。

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乖離）を低く抑えました。

また2、5、8、11月末のMSC 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 (2018年12月1日から2019年12月2日まで)

基準価額とベンチマークの対比 (騰落率)



当ファンドは、MSCI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】

当期における基準価額の騰落率は+11.9%となり、ベンチマークの騰落率+12.2%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（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	2円 ( 1) ( 0) ( 1)	0.006% (0.004) (0.000) (0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	5 ( 5) ( 0)	0.015 (0.015) (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)	16 (15) ( 1)	0.046 (0.042) (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付金・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	23	0.067	

期中の平均基準価額は35,441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 (2018年12月1日から2019年12月2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 45,643 ( 1,208)	千米ドル 377,391 ( 5,899)	百株 17,140 ( 1,164)	千米ドル 124,023 ( 11,300)
	カ ナ ダ	6,052 184)	千カナダドル 30,353 ( 433)	2,734 ( -)	千カナダドル 9,391 ( 5)
	ユ ー ロ		千ユーロ		千ユーロ
	ド イ ツ	3,258 ( 34)	16,084 (△ 217)	1,303	5,596
	イ タ リ ア	7,416	3,212	3,812	1,203
	フ ラ ン ス	3,391 ( 41)	18,431 (△ 6)	940	4,920
	オ ラ ン ダ	3,705 (△ 12)	10,184 ( -)	861 ( -)	2,264 ( 84)
	ス ペ イ ン	7,730 ( 6,571)	5,668 ( 111)	2,379 ( 6,065)	1,870 ( 112)
	ベ ル ギ ー	277	2,082	77	482
	オ ー ス ト リ ア	157 ( -)	581 (△ 18)	56	200
	ル ク セ ン ブ ル ク	931	1,072	278	405
	フ ィ ン ラ ン ド	1,169 ( 131)	1,926 ( -)	323	578
	ア イ ル ラ ン ド	411	1,301	110	475
ポ ル ト ガ ル	820	441	403	252	
国	イ ギ リ ス	43,416 ( 92,311)	千英ポンド 27,325 ( -)	98,313 ( 38)	千英ポンド 10,077 ( 410)
	ス イ ス	2,319 ( 189)	千スイスフラン 17,868 (△ 242)	548	千スイスフラン 5,409
	ス ウ ェ ー デ ン	3,471 ( 228)	千スウェーデンクローナ 48,476 ( -)	1,133 ( -)	千スウェーデンクローナ 12,677 ( 607)
	ノ ル ウ ェ ー	735 ( 54)	千ノルウェークローネ 10,987 ( -)	277	千ノルウェークローネ 4,486
	デ ン マ ー ク	579 ( 9)	千デンマーククローネ 24,806 ( -)	185	千デンマーククローネ 7,535
	オ ー ス ト ラ リ ア	9,157 (△ 7)	千オーストラリアドル 19,167 (△ 10)	3,256 ( -)	千オーストラリアドル 6,611 ( 25)

## 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	ニュージーランド	1,830	千ニュージーランドドル 1,236	827	千ニュージーランドドル 517
	香 港	11,965 ( 454)	千香港ドル 53,075 ( -)	7,037	千香港ドル 18,743
	シンガポール	5,676	千シンガポールドル 3,093	4,622	千シンガポールドル 829
	イスラエル	1,035	千イスラエルシェケル 2,253	1,090	千イスラエルシェケル 375

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※（ ）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				
	AGNC INVESTMENT CORPORATION	7,956	141 千米ドル	—	— 千米ドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	1,401	204	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	7,328	1,521	2,345	477
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	28,984	281	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,498	299	—	—
	BOSTON PROPERTIES INC	1,678	209	—	—
	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	—	—	11,010	215
	CAMDEN PROPERTY TRUST	660	73	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,603	437	1,574	183
	DUKE REALTY CORP	9,969	317	3,461	114
	EQUINIX INC	4,426	1,855	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	6,163	757	1,831	231
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC-NEW	—	—	—	—
		( 4,332)	( -)	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	3,961	311	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,247	376	628	177
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,058	124	—	—
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST HCP, INC.	1,003	136	—	—
		4,075	144	( 24,237)	( 724)
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC(NEW)	—	—	—	—
		( 24,237)	( 724)	—	—
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	5,501	92	—	—
	INVITATION HOMES INC	15,335	448	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	4,230	134	—	—
	KIMCO REALTY CORPORATION	11,493	223	6,069	115
	LIBERTY PROPERTY TRUST	2,317	117	—	—
MACERICH COMPANY/THE	1,923	62	5,729	153	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	29,675	615	—	—	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	1,021	133	—	—	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,833	103	—	—	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	12,872	541	—	—	

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		PROLOGIS INC	8,952	732	1,504	122
		PUBLIC STORAGE	1,449	341	—	—
		REALTY INCOME CORPORATION	4,333	321	—	—
		REGENCY CENTERS CORP	3,371	226	—	—
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,582	564	—	—
		SUN COMMUNITIES INC	6,358	833	1,760	237
		UDR INC	8,738	407	5,100	236
		VENTAS INC	9,317	618	3,678	249
		VEREIT INC	9,533	92	—	—
		VICI PROPERTIES INC	26,533	652	—	—
		VORNADO REALTY TRUST	1,103	70	—	—
		WP CAREY INC	4,757	414	2,811	240
		WELLTOWER INC	6,907	581	1,354	114
		WEYERHAEUSER CO	16,679	444	9,301	230
小	計	282,822 ( 28,569)	15,968 ( 724)	58,155 ( 24,237)	3,100 ( 724)	
カ ナ ダ		口	千カナダドル	口	千カナダドル	
	CAN APARTMENT PROP	4,697	257	—	—	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,566	152	—	—	
小	計	11,263	410	—	—	
ユ ー ロ	フ ラ ン ス	口	千ユーロ	口	千ユーロ	
		GECINA SA	951	137	—	—
		COVIVIO	838	71	—	—
	小	計	1,772	233	398	48
ユ ー ロ	小	計	3,561	441	398	48
ユ ー ロ	計	3,561	441	398	48	
イ ギ リ ス		口	千英ポンド	口	千英ポンド	
	BRITISH LAND CO PLC	10,190	60	—	—	
	HAMMERSON PLC	—	—	34,414	95	
	SEGRO PLC	20,438	165	—	—	
小	計	30,628	225	34,414	95	
オ ー ス ト ラ リ ア		口	千オーストラリアドル	口	千オーストラリアドル	
	MIRVAC GROUP	137,742	430	52,367	170	
	TRANSURBAN GROUP	42,076	573	5,396	72	
	APA GROUP	42,240	471	23,467	247	
	GPT GROUP	49,328	298	21,745	127	
	DEXUS	30,104	362	5,770	78	
	GOODMAN GROUP SCENTRE GROUP	22,036 56,705	278 222	— —	— —	
小	計	380,231	2,637	108,745	695	
香 港		口	千香港ドル	口	千香港ドル	
	LINK REIT	20,000	1,715	—	—	
	HKT TRUST AND HKT LTD	34,000	426	—	—	
小	計	54,000	2,142	—	—	
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	
	CAPITALAND MALL TRUST	58,000	154	—	—	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,100	95	—	—	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	( — )	(△ 1)	( — )	( 7 )	
		34,700	65	34,300	59	

## 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 国	SUNTEC REIT	112,400 ( - )	210 (△ 1)	113,400	209
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	104,900	255	-	-
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT RIGHT	-	-	18,928	4
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT RIGHT-N	-	-	-	-
		( 18,928)	( 5)		
小	計	342,100 ( 18,928)	780 ( 3)	166,628 ( - )	273 ( 7)

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※( )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	百万円	百万円	百万円	
		S P M I N I	39,655	41,330	-	-
		S P I 2 0 0	2,642	2,755	-	-
		F T S E	3,289	3,491	-	-
	D J E U R O	9,422	9,887	-	-	

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	79,649,627千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	179,517,456千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.44

※単位未満は切捨て。

※(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 (2018年12月1日から2019年12月2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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2019年12月2日現在)

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AFLAC INC	321	378	2,073	227,367	保険
AGCO CORP	22	—	—	—	資本財
AES CORPORATION	271	336	636	69,804	公益事業
AT&T INC	3,017	3,819	14,278	1,566,056	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	728	919	7,861	862,210	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	630	768	6,739	739,150	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	18	22	448	49,230	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	296	410	2,252	247,099	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	18	18	246	27,024	資本財
ADOBE INC	204	253	7,832	859,085	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	33	40	637	69,896	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	394	552	2,163	237,267	半導体・半導体製造装置
AFFILIATED MANAGERS GROUP	22	—	—	—	各種金融
AGILENT TECHNOLOGIES INC	128	160	1,294	141,945	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	89	114	2,710	297,310	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	73	83	724	79,509	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORPORATION	46	63	412	45,291	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	90	113	1,295	142,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	31	38	1,068	117,233	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORPORATION	6	8	627	68,871	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	22	22	237	26,054	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	91	132	703	77,214	公益事業
ALLSTATE CORP	142	168	1,880	206,287	保険
ALLY FINANCIAL INC	177	201	641	70,329	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	39	56	657	72,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	130	163	21,296	2,335,849	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	123	156	20,394	2,236,886	メディア・娯楽
ALTICE USA INC-A	—	63	161	17,675	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	786	975	4,849	531,874	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	171	219	39,475	4,329,654	小売
AMERCO	3	3	141	15,494	運輸
AMEREN CORPORATION	103	124	925	101,531	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	56	56	163	17,891	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER	204	263	2,409	264,278	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	303	370	4,445	487,532	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	35	35	388	42,584	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	373	464	2,445	268,214	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	70	91	1,107	121,515	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	70	79	702	77,068	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	62	67	1,112	122,038	各種金融
AMETEK INC	96	121	1,206	132,376	資本財
AMGEN INC	273	314	7,383	809,806	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORPORATION -CL A	125	151	1,575	172,788	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	214	—	—	—	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	154	187	2,117	232,281	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	36	42	1,083	118,888	ソフトウェア・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	92	—	—	—	エネルギー
ANTHEM INC	106	135	3,904	428,267	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORPORATION	163	190	424	46,581	エネルギー
APPLE INC	2,041	2,354	62,929	6,902,062	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	418	474	2,748	301,437	半導体・半導体製造装置
AQUA AMERICA INC	—	126	560	61,437	公益事業
ARAMARK	107	132	577	63,381	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	226	284	1,219	133,742	食品・飲料・タバコ

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ARCONIC INC	190	190	588	64,599	資本財
ARISTA NETWORKS INC	22	27	530	58,213	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	41	41	328	36,075	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	21	31	413	45,380	保険
ATMOS ENERGY CORP	46	64	688	75,503	公益事業
AUTODESK INC	91	111	2,019	221,506	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	40	40	326	35,861	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	183	229	3,912	429,093	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	10	12	1,470	161,234	小売
AVERY DENNISON CORP	39	48	633	69,478	素材
AVNET INC	45	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	—	228	564	61,921	各種金融
BB & T CORPORATION	317	388	2,125	233,093	銀行
BAKER HUGHES COMPANY	163	319	716	78,624	エネルギー
BALL CORPORATION	136	161	1,065	116,833	素材
BANK OF AMERICA CORP	4,002	4,621	15,398	1,688,951	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	419	436	2,139	234,703	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	211	245	2,014	220,949	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	111	141	3,645	399,880	ヘルスケア機器・サービス
BEIGENE LTD-ADR	—	19	401	44,080	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
W. R. BERKLEY CORPORATION	38	74	505	55,399	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	529	688	15,164	1,663,250	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	105	130	1,054	115,704	小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	13	490	53,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	75	90	732	80,378	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	86	98	2,947	323,307	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	—	87	553	60,760	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	49	61	3,049	334,484	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	356	1,931	211,886	各種金融
H&R BLOCK INC	78	—	—	—	消費者サービス
BOEING CO	229	279	10,250	1,124,232	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	20	22	4,295	471,129	小売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	81	593	65,143	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	85	120	507	55,690	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	573	718	3,108	340,983	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	42	—	—	—	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	679	1,221	6,952	762,598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	49	58	728	79,904	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	170	205	6,501	713,060	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	—	140	531	58,260	保険
BROWN-FORMAN CORPORATION	113	156	1,059	116,189	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	—	37	843	92,517	小売
CBS CORP-CL B	136	182	738	80,999	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC	49	56	673	73,824	各種金融
CBRE GROUP INC-A	131	161	923	101,307	不動産
CDK GLOBAL INC	50	74	400	43,979	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	63	74	999	109,670	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	101	120	554	60,829	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE, INC.	60	69	532	58,370	運輸
CIGNA CORP	101	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CIGNA CORPORATION	—	199	3,990	437,689	ヘルスケア機器・サービス
CIT GROUP INC	47	—	—	—	銀行
CME GROUP INC.	139	186	3,788	415,491	各種金融
CMS ENERGY CORPORATION	114	150	921	101,106	公益事業
CSX CORPORATION	345	389	2,788	305,849	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	535	677	5,097	559,045	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORPORATION	196	196	312	34,322	エネルギー
CADENCE DESIGN SYS INC	117	142	1,001	109,796	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	78	78	366	40,244	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	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	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	202	251	2,511	275,444	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	128	151	831	91,223	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	74	84	819	89,894	小売
CARNIVAL CORP	177	213	963	105,671	消費者サービス
CATERPILLAR INC	248	295	4,275	468,901	資本財
CELANESE CORPORATION	56	64	806	88,419	素材
CELGENE CORP	301	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	83	209	1,267	139,020	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	193	254	625	68,593	公益事業
CENTURYLINK INC	406	497	720	79,078	電気通信サービス
CERNER CORP	124	165	1,181	129,565	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	69	79	3,753	411,632	メディア・娯楽
CHEMOURS CO	80	—	—	—	素材
CHENIERE ENERGY INC	81	117	711	78,000	エネルギー
CHEVRON CORPORATION	791	984	11,534	1,265,051	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	11	14	1,143	125,425	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	99	124	876	96,183	家庭用品・パーソナル用品
CIMAREX ENERGY CO	40	—	—	—	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	63	78	841	92,262	保険
CISCO SYSTEMS INC	1,947	2,241	10,158	1,114,169	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	36	45	1,158	127,071	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	1,055	1,184	8,895	975,623	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	201	232	893	98,041	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	56	66	753	82,602	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	55	64	957	104,993	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO/THE	1,673	2,126	11,353	1,245,249	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	71	86	436	47,871	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATI	239	288	1,850	202,980	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	344	433	2,940	322,481	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CLASS A	1,899	2,374	10,483	1,149,879	メディア・娯楽
COMERICA INC	71	88	620	68,004	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	88	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONAGRA BRANDS INC	171	246	711	78,018	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	83	101	738	80,952	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	486	584	3,500	383,973	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	129	180	1,564	171,589	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	68	90	1,683	184,602	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	45	45	140	15,359	エネルギー
COOPER COMPANIES INC (THE)	20	25	785	86,158	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	85	104	930	102,066	商業・専門サービス
CORNING INC	335	397	1,155	126,744	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	—	381	991	108,763	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	182	228	6,840	750,262	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	15	18	1,135	124,555	商業・専門サービス
COTY INC-CL A	225	169	196	21,498	家庭用品・パーソナル用品
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	172	218	2,916	319,848	不動産
CROWN HOLDINGS INC	52	68	520	57,132	素材
CUMMINS INC	62	79	1,452	159,325	資本財
D. R. HORTON INC	156	190	1,055	115,794	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	73	92	1,160	127,304	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	118	158	590	64,789	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	261	335	4,899	537,412	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	53	67	796	87,322	消費者サービス
DAVITA INC	58	51	367	40,263	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	126	152	2,566	281,452	資本財
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	82	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-C	—	79	383	42,015	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	72	82	475	52,165	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	99	118	670	73,572	ヘルスケア機器・サービス

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
DEVON ENERGY CORPORATION	220	210	460	50,548	エネルギー
DEXCOM INC	—	46	1,049	115,108	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	38	79	613	67,292	エネルギー
THE WALT DISNEY CO.	615	941	14,276	1,565,803	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	144	164	1,393	152,799	各種金融
DISCOVERY INC-A	70	70	233	25,560	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	127	182	557	61,201	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP.	97	122	419	45,996	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-RIGHTS	—	6	0.45152	49	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	—	54	384	42,183	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	108	130	2,061	226,078	小売
DOLLAR TREE INC	102	120	1,101	120,847	小売
DOMINION ENERGY INC	271	435	3,617	396,743	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	16	22	653	71,626	消費者サービス
DOVER CORP	66	79	886	97,193	資本財
DOW INC	—	379	2,026	222,267	素材
DOWDUPONT INC	962	—	—	—	素材
DROPBOX INC-CLASS A	—	105	195	21,425	ソフトウェア・サービス
DUKE ENERGY CORP	291	375	3,307	362,817	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	—	381	2,469	270,906	素材
EOG RESOURCES INC	240	310	2,201	241,485	エネルギー
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	109	124	549	60,283	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	62	88	404	44,350	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	59	70	550	60,401	素材
EATON VANCE CORP	55	55	260	28,610	各種金融
EBAY INC	392	419	1,491	163,558	小売
ECOLAB INC	105	138	2,579	282,909	素材
EDISON INTERNATIONAL	135	179	1,239	135,972	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	85	105	2,589	284,043	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	179	497	54,596	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	127	150	1,522	166,990	メディア・娯楽
EMERSON ELECTRIC CO	261	328	2,426	266,157	資本財
ENTERGY CORP	71	107	1,245	136,630	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	—	30	653	71,658	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	47	61	855	93,839	商業・専門サービス
EQUINIX INC	32	—	—	—	不動産
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	12	218	23,916	保険
EVERGY INC	118	123	783	85,896	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	137	175	1,454	159,480	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	—	84	680	74,671	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	401	492	2,185	239,759	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	51	75	766	84,049	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC	68	95	711	78,003	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	233	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORPORATION	1,755	2,208	15,044	1,650,114	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	52	68	367	40,339	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FMC CORPORATION	56	66	653	71,728	素材
FACEBOOK INC-A	994	1,252	25,249	2,769,416	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	19	503	55,219	各種金融
FASTENAL COMPANY	119	290	1,030	113,060	資本財
FEDEX CORP	105	129	2,071	227,222	運輸
F5 NETWORKS INC	26	35	510	55,999	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	137	320	4,420	484,888	ソフトウェア・サービス
FINF GROUP	108	139	663	72,807	保険
FIFTH THIRD BANCORP	284	372	1,124	123,307	銀行
FIRST DATA CORP-CLASS A	209	—	—	—	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	67	91	1,009	110,702	銀行
FISERV INC	166	306	3,558	390,304	ソフトウェア・サービス
FIRSTENERGY CORP	202	269	1,285	140,955	公益事業

外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	38	43	1,341	147,140			ソフトウェア・サービス
FLUOR CORP	56	—	—	—			資本財
FLOWSERVE CORPORATION	48	66	323	35,520			資本財
FORD MOTOR COMPANY	1,545	1,987	1,800	197,454			自動車・自動車部品
FORTINET INC	59	73	773	84,849			ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	124	161	1,165	127,781			資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	64	64	408	44,752			資本財
FOX CORPORATION-CLASS A	—	197	706	77,537			メディア・娯楽
FOX CORPORATION-CLASS B	—	87	306	33,658			メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	134	178	489	53,723			各種金融
FREEMONT-MCMORAN INC	602	807	919	100,826			素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	75	93	876	96,099			保険
GAP INC/THE	92	92	153	16,793			小売
GARTNER INC	40	45	732	80,393			ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	104	131	2,383	261,464			資本財
GENERAL ELECTRIC CO	3,609	4,551	5,129	562,558			資本財
GENERAL MILLS INC	250	325	1,737	190,555			食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	527	662	2,386	261,721			自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	60	74	772	84,778			小売
GILEAD SCIENCES INC	540	662	4,457	488,910			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	66	159	2,890	317,073			ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	—	59	606	66,497			保険
GODADDY INC - CLASS A	66	89	591	64,833			ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	149	169	3,756	411,992			各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	103	—	—	—			自動車・自動車部品
WW GRAINGER INC	19	23	757	83,083			資本財
GRUBHUB INC	—	44	189	20,823			小売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	47	583	64,032			ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	116	138	1,925	211,181			ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	77	77	310	34,009			資本財
HP INC	682	763	1,533	168,217			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	364	443	930	102,025			エネルギー
HANESBRANDS INC	131	222	334	36,700			耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	73	73	267	29,315			自動車・自動車部品
HARRIS CORP	49	—	—	—			資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	152	183	1,133	124,372			保険
HASBRO INC	51	73	746	81,851			耐久消費財・アパレル
HEICO CORP	—	18	245	26,897			資本財
HEICO CORP-CLASS A	—	44	445	48,857			資本財
HELMERICH & PAYNE INC	40	—	—	—			エネルギー
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	32	39	594	65,242			ソフトウェア・サービス
THE HERSHEY COMPANY	56	75	1,113	122,103			食品・飲料・タバコ
HESS CORPORATION	110	145	900	98,786			エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	615	679	1,074	117,898			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	114	140	1,472	161,471			消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	73	94	485	53,249			エネルギー
HOLOGIC INC	121	135	697	76,506			ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	477	572	12,632	1,385,541			小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	310	377	6,746	739,976			資本財
HORMEL FOODS CORPORATION	124	149	665	72,962			食品・飲料・タバコ
HUMANA INC.	57	72	2,461	269,991			ヘルスケア機器・サービス
J. B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	35	44	509	55,936			運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	458	530	790	86,657			銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	18	21	530	58,159			資本財
IAC/INTERACTIVECORP	32	39	885	97,067			メディア・娯楽
IPG PHOTONICS CORP	17	17	252	27,677			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IDEX CORP	30	38	624	68,523			資本財
IDEXX LABORATORIES INC	36	43	1,097	120,334			ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	126	171	2,997	328,739			資本財

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ILLUMINA INC	61	74	2,390	262,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	75	92	870	95,456	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGREDION INC	33	33	276	30,285	食品・飲料・タバコ
INSULET CORP	—	34	647	71,001	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	1,929	2,313	13,430	1,473,057	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	240	285	2,692	295,314	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	381	460	6,186	678,485	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	39	48	687	75,452	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	171	191	886	97,280	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	155	196	439	48,217	メディア・娯楽
INTUIT INC	101	137	3,566	391,141	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	47	61	3,621	397,198	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	67	432	47,422	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IQVIA HOLDINGS INC	68	85	1,240	136,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	1,414	1,669	21,991	2,412,060	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	49	69	637	69,965	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	128	128	269	29,536	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	1,112	1,378	18,949	2,078,342	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	20	26	435	47,760	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	150	174	437	47,990	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KLA CORPORATION	64	81	1,342	147,281	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC -A	—	248	732	80,292	各種金融
KANSAS CITY SOUTHERN	46	51	777	85,258	運輸
KELLOGG CO	112	129	843	92,486	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	456	511	991	108,733	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	75	95	1,021	112,014	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	145	183	2,505	274,835	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	808	1,091	2,140	234,749	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	51	83	307	33,775	運輸
KOHL'S CORP	69	82	388	42,661	小売
KRAFT HEINZ COMPANY	247	340	1,037	113,768	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	326	409	1,118	122,659	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	106	—	—	—	小売
LKQ CORPORATION	139	159	561	61,610	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	33	—	—	—	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	118	2,385	261,622	資本財
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	44	49	860	94,389	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	68	76	2,028	222,479	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	74	622	68,317	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	158	176	1,106	121,364	消費者サービス
ESTEEL LAUDER COMPANIES-CL A	90	118	2,313	253,710	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	25	35	424	46,514	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	50	66	348	38,195	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	60	69	631	69,215	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	112	156	934	102,480	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	15	20	519	56,965	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	40	54	647	71,006	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	41	41	201	22,118	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	76	76	371	40,691	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	85	102	463	50,879	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	405	454	5,336	585,254	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	91	112	662	72,648	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	60	75	524	57,517	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	106	133	5,234	574,143	資本財
LOEWS CORPORATION	106	139	708	77,677	保険
LOWE'S COMPANIES INC	341	409	4,799	526,435	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	42	56	1,267	138,991	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	55	65	1,084	118,910	銀行
MGM MIRAGE	224	258	826	90,683	消費者サービス

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
MSCI INC-A	38	42	1,112	122,069	各種金融
MACY'S INC	135	—	—	—	小売
MANPOWERGROUP	32	32	302	33,164	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	368	470	547	60,093	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	287	335	2,037	223,466	エネルギー
MARKEL CORP	5	7	797	87,432	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	19	772	84,684	各種金融
MARSH & MCLENNAN COS	210	259	2,802	307,339	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	124	143	2,014	220,944	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	25	33	907	99,530	素材
MASCO CORP	119	148	692	75,996	資本財
MASTERCARD INC-CL A	383	469	13,721	1,504,927	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	—	37	263	28,849	メディア・娯楽
MATTEL INC	140	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	116	138	782	85,861	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTC SHRS	50	62	1,050	115,259	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORPORATION	326	395	7,692	843,666	消費者サービス
MCKESSON CORP	83	96	1,393	152,803	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	111	115	245	26,899	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	18	22	1,306	143,339	小売
MERCK & CO. INC.	1,113	1,328	11,580	1,270,155	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	359	409	2,044	224,231	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	11	12	905	99,262	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	3,030	3,779	57,218	6,275,737	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	101	120	1,140	125,103	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	474	588	2,793	306,405	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	23	28	326	35,842	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	28	28	399	43,764	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING COMPANY	78	96	486	53,312	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	612	751	3,949	433,156	食品・飲料・タバコ
MONGODDB INC	—	18	281	30,824	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	181	206	1,236	135,630	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	71	86	1,961	215,123	各種金融
MORGAN STANLEY	551	639	3,165	347,195	各種金融
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	135	135	78	8,661	食品・生活必需品小売り
MOSAIC CO/THE	155	185	354	38,829	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	67	83	1,397	153,328	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	—	135	538	59,032	公益事業
NVR INC	1	1	655	71,949	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC	53	65	688	75,472	各種金融
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	168	221	499	54,798	エネルギー
NEKTAR THERAPEUTICS	70	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	111	125	758	83,221	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	179	226	7,140	783,144	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	50	590	64,818	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	523	287	31,549	不動産
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	94	115	646	70,911	資本財
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	91	131	415	45,618	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	219	—	—	—	銀行
NEWELL BRANDS INC	184	184	355	38,950	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	82	—	—	—	エネルギー
NEWMONT GOLD CORP CORPORATION	212	415	1,595	175,042	素材
NEWS CORP-CLASS A	166	166	214	23,538	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	195	249	5,831	639,544	公益事業
NIKE INC -CL B	533	652	6,100	669,082	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	157	189	500	54,884	公益事業
NOBLE ENERGY INC	209	267	555	60,924	エネルギー
NORDSTROM INC	47	47	181	19,910	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	117	134	2,609	286,214	運輸

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
NORTHERN TRUST CORP	85	104	1,124	123,337	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	68	85	3,005	329,645	資本財
NORTONLIFELOCK INC	—	313	780	85,609	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	132	154	871	95,536	素材
NVIDIA CORP	239	300	6,513	714,421	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	90	116	491	53,881	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	33	39	1,755	192,533	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	318	453	1,749	191,897	エネルギー
OKTA INC	—	52	683	75,014	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	26	32	629	69,008	運輸
OMNICOM GROUP	94	118	945	103,719	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORP	174	209	448	49,244	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	170	209	1,487	163,102	エネルギー
ORACLE CORPORATION	1,265	1,226	6,885	755,147	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	48	65	437	47,940	資本財
P G & E CORPORATION	208	—	—	—	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	195	236	3,620	397,097	銀行
PPG INDUSTRIES INC	100	119	1,542	169,178	素材
PPL CORPORATION	290	365	1,245	136,595	公益事業
PVH CORP	33	33	320	35,125	耐久消費財・アパレル
PTC INC	—	54	418	45,888	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	141	175	1,429	156,779	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	40	53	597	65,526	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	39	48	1,105	121,292	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORPORATION	53	65	1,293	141,830	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	92	—	—	—	エネルギー
PAYCHEX INC	134	164	1,412	154,917	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	—	25	698	76,569	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	468	579	6,261	686,755	ソフトウェア・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	140	202	333	36,556	銀行
PEPSICO INC	586	725	9,850	1,080,450	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	—	56	522	57,304	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	2,423	2,871	11,060	1,213,087	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	645	807	6,697	734,601	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	184	230	2,640	289,661	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	51	59	523	57,471	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	—	109	213	23,391	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	70	85	1,091	119,743	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	78	—	—	—	エネルギー
POLARIS INC	24	24	241	26,435	耐久消費財・アパレル
T ROWE PRICE GROUP INC	100	119	1,481	162,502	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	119	141	778	85,356	保険
PROCTER & GAMBLE CO	1,041	1,307	15,963	1,750,822	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	237	296	2,163	237,255	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	171	205	1,927	211,392	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	209	256	1,520	166,719	公益事業
PULTE GROUP INC	129	130	518	56,817	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	48	60	629	69,058	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	579	632	5,286	579,855	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	59	68	726	79,631	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC	189	—	—	—	小売
RPM INTERNATIONAL INC	—	76	560	61,483	素材
RALPH LAUREN CORPORATION	20	33	355	39,027	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	54	64	577	63,305	各種金融
RAYTHEON COMPANY	119	147	3,214	352,524	資本財
RED HAT INC	73	—	—	—	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	33	40	1,511	165,813	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	473	558	929	101,976	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	29	30	500	54,842	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	
REPUBLIC SERVICES INC	97	114	1,011	110,989	商業・専門サービス
RESMED INC	59	72	1,087	119,303	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	41	707	77,576	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTL INC	46	70	410	45,053	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	50	60	1,175	128,921	資本財
ROKU INC	—	46	741	81,333	メディア・娯楽
ROLLINS INC	43	64	231	25,365	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	42	52	1,897	208,101	資本財
ROSS STORES INC	157	186	2,164	237,359	小売
S&P GLOBAL INC	103	128	3,412	374,271	各種金融
SBA COMMUNICATIONS CORP	47	57	1,358	148,950	不動産
SEI INVESTMENTS COMPANY	58	76	493	54,179	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	90	115	693	76,045	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	23	26	611	67,098	銀行
SABRE CORP	98	139	312	34,269	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM, INC.	292	431	7,028	770,854	ソフトウェア・サービス
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	44	504	55,286	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCANA CORP	64	—	—	—	公益事業
HENRY SCHEIN INC	60	75	520	57,123	ヘルスケア機器・サービス
SCHLUMBERGER LTD	575	736	2,666	292,516	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	504	609	3,015	330,771	各種金融
SEALED AIR CORP	58	78	297	32,671	素材
SEATTLE GENETICS INC	42	57	689	75,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMPRA ENERGY	104	139	2,048	224,730	公益事業
SERVICENOW INC	73	99	2,824	309,755	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	34	44	2,582	283,268	素材
SIGNATURE BANK	25	25	309	33,933	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	682	817	570	62,598	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	79	87	860	94,413	半導体・半導体製造装置
SMITH(A.O.) CORP	59	71	346	37,993	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	49	57	606	66,483	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	24	32	516	56,687	資本財
SNAP INC-A	—	351	535	58,712	メディア・娯楽
SOUTHERN CO	420	544	3,376	370,344	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES	55	63	364	39,929	運輸
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	51	51	446	49,012	資本財
SPLUNK INC	62	76	1,136	124,614	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	367	367	217	23,855	電気通信サービス
SQUARE INC-A	123	170	1,178	129,265	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	67	76	1,212	132,940	資本財
STARBUCKS CORP	573	629	5,379	590,026	消費者サービス
STATE STREET CORP	148	189	1,421	155,859	各種金融
STEEL DYNAMICS, INC.	101	101	343	37,701	素材
STERICYCLE, INC.	42	—	—	—	商業・専門サービス
STRYKER CORP	139	175	3,600	394,915	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	193	225	1,594	174,857	銀行
SYMANTEC CORPORATION	272	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	61	76	1,072	117,581	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	306	314	1,176	129,076	各種金融
SYSCO CORP	201	261	2,106	231,089	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	117	140	727	79,745	各種金融
TJX COMPANIES INC	521	625	3,822	419,240	小売
T-MOBILE US INC	140	173	1,361	149,287	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	48	57	692	75,958	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	119	147	395	43,390	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	210	270	3,385	371,310	小売
TARGA RESOURCES CORP	86	117	430	47,229	エネルギー
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	20	707	77,644	資本財
TELEFLEX INC	19	23	826	90,685	ヘルスケア機器・サービス

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
TERADYNE INC	—	98	616	67,564	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	54	71	2,366	259,575	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	387	569	593	65,107	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	406	486	5,853	642,052	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	106	118	545	59,860	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	167	207	6,522	715,401	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M COMPANY	246	300	5,093	558,704	資本財
TIFFANY & CO	46	55	741	81,315	小売
TOLL BROTHERS INC	70	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORPORATION	46	—	—	—	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	71	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	52	61	577	63,360	小売
TRANSIGM GROUP INC	20	24	1,376	150,958	資本財
TRANSUNION	75	94	819	89,903	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC(THE)	112	132	1,815	199,154	保険
TRIMBLE INC	103	127	517	56,717	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC-W/I	40	40	115	12,618	メディア・娯楽
TWENTY-FIRST CE CL-A	437	—	—	—	メディア・娯楽
TWENTY-FIRST CE CL-B	175	—	—	—	メディア・娯楽
TWILIO INC-A	—	56	583	63,990	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	295	370	1,144	125,525	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	22	645	70,748	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	126	149	1,343	147,384	食品・飲料・タバコ
UGI CORPORATION	74	105	461	50,574	公益事業
US BANCORP	648	788	4,734	519,333	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	—	93	277	30,468	運輸
ULTA BEAUTY INC	23	30	715	78,513	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	86	86	163	17,888	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	82	82	143	15,731	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	322	367	6,469	709,620	運輸
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	28	28	267	29,313	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	286	363	4,355	477,702	運輸
UNITED RENTALS INC	36	42	647	71,057	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	341	425	6,313	692,464	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	18	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	398	491	13,747	1,507,825	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	37	42	586	64,302	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	97	97	300	32,936	保険
VF CORP	135	171	1,515	166,224	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	16	20	494	54,243	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	179	211	2,020	221,584	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	41	51	694	76,197	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	50	64	966	106,042	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	43	54	1,037	113,785	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,711	2,163	13,031	1,429,259	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	62	78	1,162	127,528	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	105	131	2,926	320,947	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC-CLASS B	146	202	488	53,525	メディア・娯楽
VISA INC	740	902	16,649	1,826,111	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	138	183	486	53,406	公益事業
VMWARE INC	30	41	652	71,584	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	75	73	425	46,713	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	54	66	950	104,222	素材
WABCO HOLDINGS INC	21	25	350	38,396	資本財
WEC ENERGY GROUP INC	131	159	1,417	155,521	公益事業
WABTEC CORP	34	92	725	79,548	資本財
WALMART INC	613	742	8,838	969,406	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	350	394	2,348	257,600	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	109	133	1,210	132,794	商業・専門サービス

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
WASTE MANAGEMENT INC	176	226	2,556	280,360	商業・専門サービス
WATERS CORP	34	35	782	85,808	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC-CLASS A	—	28	245	26,889	小売
WELLCARE HEALTH PLANS INC	—	25	821	90,113	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & COMPANY	1,923	2,190	11,927	1,308,226	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	42	626	68,697	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN DIGITAL CORP	129	148	747	82,013	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION COMPANY	190	218	587	64,388	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	14	14	101	11,110	素材
WESTROCK CO	113	130	525	57,654	素材
WHIRLPOOL CORP	26	32	459	50,413	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	502	614	1,396	153,116	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A	60	88	1,593	174,730	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CL A	123	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WYNN RESORTS LTD	42	49	593	65,120	消費者サービス
XPO LOGISTICS INC	49	47	389	42,771	運輸
XCEL ENERGY INC	205	260	1,604	176,010	公益事業
XILINX INC	110	128	1,194	131,027	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	96	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XYLEM INC	79	91	707	77,565	資本財
XEROX HOLDINGS CORP	—	96	377	41,404	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUM! BRANDS INC	134	155	1,561	171,308	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	92	119	409	44,862	電気通信サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	27	686	75,330	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZILLOW GROUP INC-C	53	53	208	22,843	メディア・娯楽
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	82	103	1,508	165,477	ヘルスケア機器・サービス
ZIONS BANCORPORATION	88	88	441	48,450	銀行
ZOETIS INC	201	253	3,057	335,396	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALKERMES PLC	64	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGION PLC	39	47	571	62,717	資本財
ALLERGAN PLC	140	174	3,219	353,168	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMCOR PLC	—	823	844	92,615	素材
AON PLC	101	121	2,483	272,360	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	178	204	859	94,256	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	60	81	369	40,484	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	39	—	—	—	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	107	125	358	39,313	素材
ACCENTURE PLC-CL A	267	331	6,661	730,667	ソフトウェア・サービス
BUNGE LIMITED	59	71	382	42,001	食品・飲料・タバコ
CAPRI HOLDINGS LTD	—	62	231	25,373	耐久消費財・アパレル
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	93	125	634	69,595	食品・飲料・タバコ
EATON CORP PLC	181	214	1,984	217,659	資本財
EVEREST RE GROUP LTD	16	20	560	61,437	保険
IHS MARKIT LTD	162	192	1,399	153,444	商業・専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC	103	122	1,603	175,840	資本財
INVESCO LIMITED	183	183	321	35,299	各種金融
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	26	26	393	43,160	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	395	403	1,728	189,585	資本財
LIBERTY GLOBAL PLC-A	84	84	190	20,854	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	235	210	453	49,706	メディア・娯楽
LINDE PLC	225	279	5,755	631,311	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	268	317	837	91,829	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	562	703	7,841	860,021	ヘルスケア機器・サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	62	—	—	—	耐久消費財・アパレル
APTIV PLC	105	130	1,227	134,619	自動車・自動車部品
NIELSEN HOLDINGS PLC	151	180	352	38,652	商業・専門サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	91	109	585	64,256	消費者サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	15	22	421	46,248	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	113	126	753	82,698	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		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PENTAIR PLC-REGISTERED	70	99	441	48,414	資本財
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	71	95	489	53,684	資本財
STERIS PLC	—	42	647	71,065	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC	181	215	406	44,600	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	54	65	1,287	141,187	保険
PERRIGO CO PLC	55	77	396	43,473	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHUBB LTD	191	239	3,624	397,514	保険
GARMIN LTD	49	67	658	72,205	耐久消費財・アパレル
TE CONNECTIVITY LTD	145	170	1,583	173,697	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	52	65	777	85,306	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	23	283	31,062	ソフトウェア・サービス
WIX.COM LTD	—	24	292	32,074	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	48	70	438	48,065	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	135	142	1,317	144,532	素材
MYLAN NV	225	261	490	53,838	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV	142	149	1,732	190,063	半導体・半導体製造装置
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	67	90	1,084	118,948	消費者サービス
FLEX LTD	232	232	275	30,209	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数 127,595	株数 156,142	外貨建金額 1,396,454	邦貨換算金額 153,163,129	
	銘柄数 595			<65.9%>	
(カナダ)			千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD	170	—	—	—	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	96	119	939	77,625	素材
AIR CANADA	—	57	287	23,723	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	302	563	46,596	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	183	462	2,009	166,010	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	97	173	341	28,234	公益事業
ATCO LTD-CLASS I	30	30	152	12,614	公益事業
AURORA CANNABIS INC	285	285	94	7,834	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	69	83	535	44,263	電気通信サービス
BANK OF MONTREAL	262	336	3,440	284,247	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	492	629	4,719	389,961	銀行
BARRICK GOLD CORP	502	932	2,068	170,918	素材
BAUSCH HEALTH COS INC	118	190	714	59,050	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKBERRY LIMITED	180	259	190	15,741	ソフトウェア・サービス
BOMBARDIER INC 'B'	758	758	149	12,345	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	343	464	3,567	294,749	各種金融
CAE INC	139	128	460	38,011	資本財
CCL INDUSTRIES INC-CL B	53	91	521	43,078	素材
CGI INC-CL A	—	124	1,369	113,110	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	110	110	230	19,083	各種金融
CAMECO CORP	163	163	198	16,379	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	191	225	2,603	215,082	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	302	372	4,489	370,919	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES	499	628	2,332	192,751	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	59	70	2,230	184,267	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	24	35	547	45,263	小売
CANADIAN UTILITIES LIMITED	39	73	286	23,700	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	83	112	275	22,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENOVUS ENERGY INC	414	540	634	52,395	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE	8	11	1,570	129,757	ソフトウェア・サービス
CRESCENT POINT ENERGY CORP	225	—	—	—	エネルギー
CRONOS GROUP INC	—	80	72	5,987	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC	119	145	706	58,378	小売
EMERA INC	24	134	732	60,483	公益事業
EMPIRE CO LTD A	72	72	257	21,262	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	418	663	345	28,571	エネルギー
ENBRIDGE INC	701	1,042	5,243	433,228	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	11	13	835	69,054	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	
FINNING INTERNATIONAL INC	61	—	—	—	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	65	65	141	11,671	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	316	316	384	31,793	素材
FORTIS INC	179	219	1,139	94,181	公益事業
FRANCO-NEVADA CORPORATION	80	94	1,240	102,486	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	90	90	353	29,212	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	333	—	—	—	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	142	142	474	39,243	保険
CGI GROUP INC - CL A	101	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	145	145	140	11,626	エネルギー
HYDRO ONE LTD	150	150	376	31,114	公益事業
IGM FINANCIAL INC	30	64	245	20,303	各種金融
IA FINANCIAL CORP INC	—	48	329	27,253	保険
IMPERIAL OIL LTD	129	129	432	35,720	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	48	—	—	—	保険
INTACT FINANCIAL CORPORATION	62	70	966	79,871	保険
INTER PIPELINE LTD	180	252	555	45,891	エネルギー
KEYERA CORP	84	113	368	30,456	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	570	635	364	30,114	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	113	632	52,219	素材
LINAMAR CORP	22	—	—	—	自動車・自動車部品
LOBLAW COMPANIES LTD	85	85	611	50,513	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	282	282	202	16,757	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	146	166	1,216	100,492	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	804	998	2,608	215,478	保険
METHANEX CORPORATION	24	24	121	10,013	素材
METRO INC	91	142	829	68,492	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	147	169	1,209	99,891	銀行
NUTRIEN LTD	262	300	1,883	155,625	素材
ONEX CORPORATION	42	42	333	27,559	各種金融
OPEN TEXT CORPORATION	116	136	790	65,290	ソフトウェア・サービス
PARKLAND FUEL CORP	—	76	361	29,907	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	217	274	1,271	105,036	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	145	145	470	38,876	保険
POWER FINANCIAL CORP	110	162	526	43,475	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	90	90	123	10,230	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	—	99	327	27,087	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	91	130	1,137	93,985	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	145	183	1,180	97,521	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	595	753	8,197	677,248	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	82	—	—	—	資本財
SAPUTO INC	98	134	539	44,533	食品・飲料・タバコ
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	85	—	—	—	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	193	265	728	60,172	メディア・娯楽
SHOPIFY INC-CLASS A	38	51	2,306	190,529	ソフトウェア・サービス
STARS GROUP INC/THE	—	145	463	38,329	消費者サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	258	300	1,823	150,673	保険
SUNCOR ENERGY INC	678	814	3,375	278,901	エネルギー
TC ENERGY CORP	—	481	3,233	267,143	エネルギー
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	198	248	516	42,642	素材
TELUS CORPORATION	76	76	381	31,535	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	—	110	1,021	84,426	商業・専門サービス
THOMSON REUTERS CORP-NEW	78	—	—	—	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	761	950	7,278	601,362	銀行
TOURMALINE OIL CORP	128	—	—	—	エネルギー
TRANSCANADA CORP	363	—	—	—	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	451	—	—	—	素材
VERMILION ENERGY INC	55	—	—	—	エネルギー
WSP GLOBAL INC	45	63	548	45,281	資本財

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	28	28	165	13,712	素材
WESTON (GEORGE) LTD	31	42	462	38,213	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	195	246	901	74,470	素材
小計	17,304	20,806	101,017	8,346,043	
	株数	株数	評価額	評価額	
	89	86	—	< 3.6% >	
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	76	94	2,675	323,380	耐久消費財・アパレル
FRESENIUS SE & CO KGAA	168	211	1,050	126,961	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	59	68	210	25,498	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE-PREF	33	33	132	15,966	素材
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	23	30	515	62,275	保険
GEA GROUP AG	81	81	238	28,831	資本財
CONTINENTAL AG	46	55	661	79,955	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	413	519	1,756	212,343	運輸
AXEL SPRINGER SE	16	—	—	—	メディア・娯楽
MERCK KGAA	57	65	694	83,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	228	296	796	96,298	公益事業
SAP SE	405	509	6,295	760,934	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	883	1,158	1,100	133,018	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	46	57	504	60,931	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	2	38	261	31,569	耐久消費財・アパレル
BAYER AG	384	480	3,303	399,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA	71	90	867	104,790	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	380	481	3,285	397,082	素材
BEIERSDORF AG	40	56	592	71,640	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	8	8	91	11,117	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	65	83	560	67,716	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	91	109	727	87,909	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG	181	220	4,795	579,544	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	92	92	159	19,271	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	60	76	2,004	242,299	保険
VOLKSWAGEN AG	12	19	343	41,518	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD	75	94	1,651	199,572	自動車・自動車部品
DAIMLER AG	372	484	2,478	299,544	自動車・自動車部品
THYSSENKRUPP AG	193	193	220	26,637	素材
SIEMENS AG-REG	315	402	4,719	570,423	資本財
1&1 DRILLISCH AG	21	—	—	—	電気通信サービス
DEUTSCHE BANK AG -REG	789	995	651	78,742	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	140	167	1,230	148,734	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE (BMW) AG-PFD	25	25	140	16,974	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,366	1,734	2,643	319,470	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	13	18	345	41,709	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	484	655	1,271	153,629	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	22	251	30,439	ヘルスケア機器・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	82	96	1,341	162,137	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	66	77	521	63,046	自動車・自動車部品
FRAPORT AG	18	18	143	17,344	運輸
WIRECARD AG	48	59	713	86,179	ソフトウェア・サービス
LANXESS	31	44	266	32,238	素材
MTU AERO ENGINES AG	20	28	702	84,878	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	142	181	643	77,737	不動産
SYMRISE AG	49	65	574	69,418	素材
BRENNTAG AG	66	91	444	53,663	資本財
K+S AG	96	—	—	—	素材
EVONIK INDUSTRIES AG	64	118	311	37,679	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	403	403	111	13,528	電気通信サービス
HUGO BOSS AG	22	—	—	—	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	466	466	245	29,658	銀行
OSRAM LICHT AG	45	—	—	—	資本財

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
KION GROUP AG	31	31	191	23,137	資本財
VONOVIA SE	200	275	1,303	157,546	不動産
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	108	—	—	—	メディア・娯楽
KNORR-BREMSE AG	—	21	188	22,811	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	65	87	383	46,344	ヘルスケア機器・サービス
METRO AG	83	83	122	14,748	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE	58	—	—	—	公益事業
AXEL SPRINGER SE-TEND	—	23	146	17,698	メディア・娯楽
ZALANDO SE	53	82	323	39,147	小売
COVESTRO AG	80	80	342	41,364	素材
SCHAEFFLER AG	95	—	—	—	自動車・自動車部品
UNIPER SE	89	123	362	43,762	公益事業
DELIVERY HERO SE	34	53	256	30,944	小売
小計	10,261	12,251	58,869	7,114,915	
	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	63	58	—	<3.1%>	
<b>(ユーロ・・・イタリア)</b>					
ASSICURAZIONI GENERALI	469	586	1,086	131,312	保険
INTESA SANPAOLO	6,179	7,792	1,792	216,664	銀行
MEDIOBANCA SPA	267	267	271	32,854	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA	72	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ENEL SPA	3,320	4,202	2,880	348,196	公益事業
ENI SPA	1,057	1,304	1,789	216,265	エネルギー
SNAM SPA	999	896	404	48,873	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	4,940	4,919	279	33,785	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	2,513	2,513	140	16,983	電気通信サービス
ATLANTIA SPA	198	265	533	64,442	運輸
TERNA SPA	663	804	469	56,708	公益事業
RECORDATI SPA	45	45	174	21,064	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEONARDO SPA	183	183	194	23,490	資本財
PRYSMIAN SPA	93	119	246	29,822	資本財
MONCLER SPA	77	77	306	37,063	耐久消費財・アパレル
FINECOBANK SPA	—	320	360	43,594	銀行
UNICREDIT SPA	812	1,068	1,342	162,277	銀行
POSTE ITALIANE SPA	265	265	281	33,996	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	229	361	299	36,195	食品・飲料・タバコ
PIRELLI & C SPA	174	174	90	10,882	自動車・自動車部品
小計	22,565	26,169	12,944	1,564,475	
	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	19	19	—	<0.7%>	
<b>(ユーロ・・・フランス)</b>					
BOUYGUES SA	83	110	409	49,515	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	215	290	675	81,682	公益事業
L'OREAL	103	129	3,351	405,119	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	114	146	5,951	719,245	耐久消費財・アパレル
DASSAULT AVIATION SA	0.89	1	212	25,673	資本財
THALES SA	45	54	480	58,065	資本財
CAPGEMINI SA	65	80	865	104,560	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	18	18	73	8,848	食品・生活必需品小売り
INGENICO S.A.	26	26	260	31,502	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PUBLICIS GROUPE	91	107	428	51,824	メディア・娯楽
FAURECIA	31	31	150	18,193	自動車・自動車部品
BOLLORE	394	394	153	18,491	運輸
MICHELIN (CGDE)-B	68	87	952	115,111	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD SA	86	110	1,848	223,454	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	76	88	383	46,374	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	12	12	148	17,985	食品・飲料・タバコ
SEB SA	10	10	145	17,586	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE	233	285	2,502	302,427	資本財
VIVENDI SA	454	475	1,184	143,161	メディア・娯楽
ORANGE S.A.	829	1,048	1,572	190,107	電気通信サービス

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
HERMES INTERNATIONAL	13	16	1,149	138,892	耐久消費財・アパレル
BIC	13	—	—	—	商業・専門サービス
DASSAULT SYSTEMES SA	55	66	953	115,208	ソフトウェア・サービス
KERING	30	39	2,179	263,437	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES	89	89	160	19,444	保険
CARREFOUR SA	263	351	526	63,598	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	36	45	350	42,359	ソフトウェア・サービス
SANOFI	464	593	5,013	605,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA	75	106	414	50,121	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	311	410	1,171	141,608	銀行
TELEPERFORMANCE	24	29	638	77,175	商業・専門サービス
EURAZEO	21	17	110	13,395	各種金融
SODEXO	39	39	412	49,869	消費者サービス
AXA SA	794	1,028	2,538	306,829	保険
PSA PEUGEOT CITROEN	261	321	704	85,165	自動車・自動車部品
JC DECAUX SA	28	28	73	8,886	メディア・娯楽
ESSILORLUXOTTICA	88	147	2,083	251,869	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA	495	581	721	87,237	銀行
BNP PARIBAS	461	577	2,942	355,673	銀行
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	212	255	940	113,629	資本財
WENDEL	10	10	132	15,993	各種金融
ILIAD SA	10	10	117	14,188	電気通信サービス
IMERYS SA	13	—	—	—	素材
SAFRAN SA	136	171	2,552	308,524	資本財
ENGIE	736	962	1,381	167,017	公益事業
ALSTOM RGPT	64	96	382	46,248	資本財
EUTELSAT COMMUNICATIONS	87	87	129	15,703	メディア・娯楽
ELECTRICITE DE FRANCE (EDF)	238	286	267	32,272	公益事業
IPSEN	14	14	153	18,557	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARKEMA	32	32	305	36,946	素材
LEGRAND SA	106	143	1,028	124,317	資本財
EIFFAGE SA	35	46	459	55,586	資本財
TOTAL SA	989	1,260	6,005	725,847	エネルギー
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	13	13	238	28,875	運輸
NATIXIS	453	453	172	20,794	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	35	52	287	34,728	メディア・娯楽
SCOR SE	71	95	373	45,148	保険
REXEL SA	128	—	—	—	資本財
VINCI S. A.	209	264	2,614	315,995	資本財
DANONE	251	319	2,389	288,764	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE SA	175	244	3,003	362,976	素材
BUREAU VERITAS SA	126	172	409	49,492	商業・専門サービス
GETLINK	169	223	341	41,283	運輸
SUEZ	177	145	195	23,602	公益事業
EDENRED	94	121	546	66,093	商業・専門サービス
VALEO SA	99	140	502	60,714	自動車・自動車部品
BIOMERIEUX	17	17	145	17,641	ヘルスケア機器・サービス
WORLDLINE SA	—	62	365	44,222	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	—	15	224	27,081	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	23	39	271	32,838	各種金融
小計	株数 銘柄数	11,269 68	13,762 67	69,838 —	8,440,680 <3.6%>
<b>(ユーロ・・・オランダ)</b>					
AIRBUS SE	239	300	4,005	484,084	資本財
RANDSTAD NV	46	46	248	29,988	商業・専門サービス
AKZO NOBEL	108	—	—	—	素材
WOLTERS KLUWER-CVA	128	149	972	117,530	商業・専門サービス
VOPAK	31	31	151	18,305	エネルギー
AEGON NV	745	916	374	45,306	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 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	
KONINKLIJKE KPN NV	1,415	1,996	558	67,450	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	280	376	839	101,411	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV	390	469	1,979	239,223	ヘルスケア機器・サービス
HEINEKEN NV	104	131	1,235	149,379	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV	52	65	567	68,556	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	73	92	1,069	129,315	素材
UNILEVER NV-CVA	635	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
UNILEVER NV	—	763	4,109	496,682	家庭用品・パーソナル用品
ASML HOLDING NV	168	218	5,407	653,499	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	504	600	1,403	169,643	食品・生活必需品小売り
FERRARI NV	48	65	1,009	121,974	自動車・自動車部品
CNH INDUSTRIAL NV	431	570	554	67,055	資本財
AKZO NOBEL	—	122	1,060	128,162	素材
PROSUS NV	—	254	1,576	190,574	小売
NN GROUP NV	129	159	554	67,043	保険
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	431	594	798	96,490	自動車・自動車部品
ABN AMRO BANK NV-CVA	189	189	293	35,413	銀行
EXOR NV	46	63	442	53,460	各種金融
ALTICE NV -A W/I	—	376	203	24,564	メディア・娯楽
QIAGEN N.V.	100	138	536	64,827	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADYEN NV	—	6	433	52,336	ソフトウェア・サービス
ING GROEP NV-CVA	1,592	2,031	2,121	256,401	銀行
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	7,897 23	10,729 26	32,506 —	3,928,681 <1.7%>	
<b>(ユーロ・・・スペイン)</b>					
ENDESA S.A.	129	183	452	54,693	公益事業
BANKINTER, S.A.	269	364	231	27,930	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA	2,770	3,430	1,640	198,218	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	161	154	364	44,036	公益事業
REPSOL SA	565	736	1,052	127,255	エネルギー
BANCO SANTANDER SA	6,728	8,522	3,014	364,321	銀行
TELEFONICA S.A.	1,912	2,406	1,672	202,189	電気通信サービス
ENAGAS	104	104	236	28,613	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	114	114	166	20,101	資本財
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	115	145	514	62,235	資本財
FERROVIAL SA	187	231	622	75,286	資本財
MAPPFRE SA	463	463	118	14,340	保険
BANCO DE SABADELL SA	2,350	3,280	330	39,922	銀行
CAIXABANK	1,491	1,819	487	58,922	銀行
IBERDROLA SA	2,448	3,198	2,855	345,141	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA	182	222	1,608	194,433	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROU	232	—	—	—	運輸
FERROVIAL SA-RIGHTS	187	—	—	—	資本財
RED ELECTRICA CORPORATION SA	183	207	367	44,422	公益事業
FERROVIAL SA-RIGHTS	—	231	9	1,174	資本財
INDITEX	450	556	1,573	190,223	小売
AENA SME SA	28	37	623	75,371	運輸
CELLNEX TELECOM SA	—	137	535	64,679	電気通信サービス
GRIFOLS S.A.	119	170	529	63,983	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANKIA SA	483	820	144	17,432	銀行
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	21,683 23	27,539 23	19,153 —	2,314,925 <1.0%>	
<b>(ユーロ・・・ベルギー)</b>					
KBC GROUPE SA	108	129	856	103,486	銀行
SOLVAY SA	28	37	390	47,235	素材
UCB SA	52	72	530	64,091	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT NV	31	24	116	14,041	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	33	47	435	52,628	各種金融
PROXIMUS SA	63	63	172	20,890	電気通信サービス

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
GALAPAGOS NV	—	23	414	50,105	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELENET GROUP HOLDINGS NV	21	21	89	10,796	メディア・娯楽
AGEAS	72	87	477	57,712	保険
UMICORE	87	113	442	53,471	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	313	392	2,818	340,690	食品・飲料・タバコ
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	6,744	815,151	
			—	< 0.4% >	
<b>(ユーロ・・・オーストリア)</b>					
OMV AG	63	77	402	48,656	エネルギー
VERBUND AG	—	36	174	21,052	公益事業
VOESTALPINE AG	50	50	122	14,763	素材
ERSTE GROUP BANK AG	120	169	551	66,669	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	66	55	117	14,178	銀行
ANDRITZ AG	25	37	131	15,950	資本財
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	1,499	181,269	
			—	< 0.1% >	
<b>(ユーロ・・・ルクセンブルク)</b>					
EUROFINS SCIENTIFIC	4	7	334	40,378	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS S. A.	184	259	250	30,286	エネルギー
SES	138	176	213	25,748	メディア・娯楽
RTL GROUP	16	—	—	—	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA	—	458	361	43,708	不動産
ARCELORMITTAL	265	359	558	67,541	素材
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	1,718	207,663	
			—	< 0.1% >	
<b>(ユーロ・・・フィンランド)</b>					
WARTSILA OYJ-B SHARES	189	189	172	20,872	資本財
UPM-KYMMENE OYJ	213	290	882	106,606	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS	247	247	301	36,433	素材
SAMPO OYJ-A SHS	177	236	867	104,901	保険
FORTUM OYJ	170	244	522	63,192	公益事業
ELISA OYJ	59	83	404	48,855	電気通信サービス
METSO OYJ	39	58	204	24,730	資本財
NOKIA OYJ	2,340	2,857	917	110,924	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ	56	227	698	84,386	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	55	55	135	16,346	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B	146	182	1,037	125,396	資本財
ORION OYJ	42	42	168	20,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	6,312	762,978	
			—	< 0.3% >	
<b>(ユーロ・・・アイルランド)</b>					
CRH PLC	349	406	1,412	170,773	素材
KERRY GROUP PLC-A	68	83	972	117,496	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC	—	76	373	45,123	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	101	114	368	44,524	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC	376	521	237	28,745	銀行
AIB GROUP PLC	369	369	109	13,251	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	34	45	477	57,769	消費者サービス
RYANAIR HOLDINGS PLC	16	—	—	—	運輸
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	3,952	477,686	
			—	< 0.2% >	
<b>(ユーロ・・・ポルトガル)</b>					
BANCO ESPERITO SANTO, S.A(BES)	1,879	1,879	1	227	銀行
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	979	1,363	500	60,475	公益事業
GALP ENERGIA SGPS S. A	209	241	356	43,133	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	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
JERONIMO MARTINS SGPS S. A.	122	123	179	21,682	食品・生活必需品小売り
小 計	3,190	3,607	1,038	125,519	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	4	4	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	83,670	103,095	214,578	25,933,947	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	239	238	—	<1.2%>	
(イギリス)			千英ポンド		
ANTOFAGASTA PLC	194	194	168	23,890	素材
ASHTAD GROUP PLC	192	236	556	78,811	資本財
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	397	587	391	55,453	耐久消費財・アパレル
AVIVA PLC	1,608	1,986	801	113,548	保険
DIAGEO PLC	1,022	1,219	3,858	546,282	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	62	62	204	29,021	各種金融
DCC PLC	37	47	312	44,292	資本財
BAE SYSTEMS PLC	1,285	1,706	978	138,512	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	946	1,178	3,607	510,802	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC	—	211	445	63,114	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC	1,224	1,415	987	139,800	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	389	496	845	119,755	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	8,294	10,485	6,042	855,569	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,492	3,022	849	120,217	保険
MEGGITT PLC	369	369	237	33,649	資本財
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	1,008	1,462	289	41,058	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	167	167	430	61,003	食品・飲料・タバコ
PEARSON PLC	296	396	256	36,275	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	139	169	432	61,267	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	1,062	1,330	1,831	259,339	保険
RIO TINTO PLC	487	586	2,465	349,087	素材
ST JAMES'S PLACE PLC	218	319	347	49,266	各種金融
TRAVIS PERKINS PLC	92	—	—	—	資本財
SSE PLC	445	548	713	100,964	公益事業
BP PLC	8,272	10,558	5,070	717,887	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	29,961	36,841	2,252	318,982	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	1,296	1,476	257	36,440	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	4,269	5,160	1,183	167,629	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	354	443	767	108,710	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,045	2,589	4,542	643,106	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	92	167	233	33,017	資本財
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	114	—	—	—	商業・専門サービス
ASTRAZENECA PLC	522	681	5,080	719,406	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	3,652	4,542	870	123,205	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	80	80	263	37,266	消費者サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	713	1,247	242	34,328	小売
BARCLAYS PLC	6,968	9,260	1,588	224,932	銀行
INTERTEK GROUP PLC	67	81	451	63,917	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	174	230	485	68,714	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	54	76	518	73,381	小売
KINGFISHER PLC	799	1,096	230	32,596	小売
ITV PLC	1,510	2,150	312	44,183	メディア・娯楽
SAINSBURY (J) PLC	641	1,128	241	34,230	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	38	—	—	—	素材
G4S PLC	742	742	155	21,994	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	78	121	259	36,690	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	53	53	244	34,648	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	2,549	2,549	204	28,954	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,901	2,237	4,946	700,395	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,547	1,944	4,257	602,835	エネルギー
BUNZL PLC	134	170	362	51,293	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC	—	905	402	57,041	商業・専門サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	129	159	1,096	155,223	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	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
UNILEVER PLC	501	588	2,693	381,316	家庭用品・パーソナル用品	
TUI AG-DI	176	176	187	26,556	消費者サービス	
INVESTEC PLC	330	—	—	—	各種金融	
EXPERIAN PLC	381	479	1,229	174,146	商業・専門サービス	
MONDI PLC	140	251	421	59,612	素材	
SEVERN TRENT PLC	98	144	324	45,942	公益事業	
WHITBREAD PLC	77	68	312	44,305	消費者サービス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	110	144	267	37,902	各種金融	
SMITHS GROUP PLC	187	235	390	55,338	資本財	
ANGLO AMERICAN PLC	447	559	1,133	160,547	素材	
3I GROUP PLC	377	493	528	74,817	各種金融	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	274	366	2,221	314,523	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	806	1,029	1,928	273,111	商業・専門サービス	
SHIRE PLC	386	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FRESNILLO PLC	85	—	—	—	素材	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	250	332	283	40,124	公益事業	
OCADO GROUP PLC	—	221	293	41,605	小売	
GLENCORE PLC	4,722	5,567	1,357	192,250	素材	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	326	—	—	—	エネルギー	
GVC HOLDINGS PLC	238	238	203	28,748	消費者サービス	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	716	869	618	87,573	資本財	
EVRAZ PLC	—	282	104	14,828	素材	
NMC HEALTH PLC	37	68	171	24,274	ヘルスケア機器・サービス	
EASYJET PLC	76	76	102	14,454	運輸	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,091	2,452	554	78,545	銀行	
SAGE GROUP PLC/THE	409	620	467	66,213	ソフトウェア・サービス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	198	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
WPP PLC	545	639	640	90,644	メディア・娯楽	
COCA-COLA HBC AG-CDI	87	87	224	31,783	食品・飲料・タバコ	
AVEVA GROUP PLC	—	35	160	22,762	ソフトウェア・サービス	
CONVATEC GROUP PLC	612	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
COMPASS GROUP PLC	652	826	1,566	221,817	消費者サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	76	—	—	—	消費者サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	182	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
NATIONAL GRID PLC	1,366	1,783	1,586	224,702	公益事業	
ROYAL MAIL PLC	360	—	—	—	運輸	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	325	—	—	—	消費者サービス	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,024	1,232	390	55,307	各種金融	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	32,972	—	—	—	資本財	
FERGUSON PLC	99	—	—	—	資本財	
BHP GROUP PLC	899	1,070	1,831	259,302	素材	
VODAFONE GROUP PLC	10,933	13,673	2,097	296,920	電気通信サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	—	97	485	68,795	消費者サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	—	151	171	24,237	ソフトウェア・サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	—	74	372	52,756	素材	
FERGUSON PLC	—	122	822	116,467	資本財	
M&G PLC	—	1,330	314	44,463	各種金融	
RSA INSURANCE GROUP PLC	405	522	288	40,828	保険	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENTITLEMENT	—	39,981	3	566	資本財	
INFORMA PLC	546	690	546	77,428	メディア・娯楽	
AUTO TRADER GROUP PLC	420	420	236	33,463	メディア・娯楽	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	36	328	46,567	資本財	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	632	632	193	27,367	保険	
JD SPORTS FASHION PLC	—	288	219	31,080	小売	
CRODA INTERNATIONAL PLC	62	—	—	—	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,125	2,463	565	80,085	資本財	
JOHNSON MATTHEY PLC	72	100	289	40,994	素材	
小 計	株 数 銘柄 数	金 額 比 率	159,056 97	196,431 94	92,711 —	13,127,085 < 5.6% >

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)			千スイスフラン		
SGS SA	2	2	666	72,999	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	377	41,411	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM AG-REG	10	14	740	81,171	電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG	0.45	0.49	373	40,945	食品・飲料・タバコ
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	0.04	0.05	426	46,740	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	3	4	1,387	152,024	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	64	77	3,047	333,963	保険
NOVARTIS AG-REG SHS	900	1,124	10,347	1,133,997	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	751	964	2,108	231,119	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	290	363	11,197	1,227,102	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	70	70	433	47,552	商業・専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD	206	257	1,329	145,742	素材
CLARIANT AG-REG	101	101	208	22,869	素材
NESTLE SA-REGISTERED	1,290	1,551	16,125	1,767,145	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG	19	24	430	47,140	保険
TEMENOS GROUP AG-REG	24	36	553	60,680	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG	26	26	603	66,126	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4	5	576	63,149	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,039	1,296	1,698	186,140	各種金融
THE SWATCH GROUP AG-B	13	13	372	40,811	耐久消費財・アパレル
THE SWATCH GROUP AG-REG	25	25	134	14,696	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	31	37	1,282	140,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG	14	17	860	94,270	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	3	5	325	35,700	素材
SWISS PRIME SITE-REG	32	39	412	45,202	不動産
PARGESA HOLDING SA-BR	18	18	147	16,143	各種金融
DUFREY AG-REG	11	22	220	24,189	小売
PARTNERS GROUP HOLDING AG	6	9	820	89,911	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	17	23	578	63,438	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	7	12	310	34,051	資本財
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	23	23	384	42,089	運輸
GEBERIT AG-REG	15	19	1,073	117,596	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD	95	126	596	65,350	各種金融
SWISS RE AG	132	154	1,673	183,405	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	212	272	2,076	227,522	耐久消費財・アパレル
SIKA AG	52	64	1,126	123,409	素材
ALCON INC	—	210	1,162	127,440	ヘルスケア機器・サービス
UBS GROUP AG	1,584	2,037	2,469	270,616	各種金融
VIFOR PHARMA AG	17	26	470	51,546	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	7,124	9,085	69,129	7,575,947	
	銘柄数	38	—	< 3.3% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS	31	31	1,189	13,633	各種金融
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	647	887	7,292	83,567	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES	390	459	5,726	65,623	銀行
SWEDISH MATCH AB	75	101	4,655	53,350	食品・飲料・タバコ
SECURITAS AB-B SHS	122	199	3,163	36,249	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	198	242	12,297	140,930	各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	362	437	8,081	92,614	小売
ERICSSON LM-B SHS	1,265	1,594	13,756	157,647	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELI A CO AB	1,269	1,269	5,262	60,309	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	157	157	3,324	38,098	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB	68	113	3,359	38,498	エネルギー
ALFA LAVAL AB	120	139	3,284	37,634	資本財
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	26	26	1,154	13,226	電気通信サービス
ICA GRUPPEN AB	35	35	1,483	17,005	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	185	185	1,390	15,933	耐久消費財・アパレル
ELECTROLUX AB-SER B	110	91	2,255	25,848	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	外貨建金額	邦貨換算金額	
SKF AB-B SHARES	166	206	3,769	43,192	資本財
VOLVO AB-B SHS	645	795	11,772	134,909	資本財
SANDVIK AB	450	609	10,622	121,739	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	62	62	1,391	15,948	各種金融
HEXAGON AB-B SHS	110	132	7,148	81,917	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELE2 AB-B SHS	131	291	4,120	47,217	電気通信サービス
KINNEVIK AB-B SHS	112	—	—	—	各種金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	267	359	12,600	144,401	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	161	197	6,126	70,204	資本財
BOLIDEN AB	102	—	—	—	素材
EPIROC AB-A	302	302	3,381	38,755	資本財
EPIROC AB-B	161	161	1,733	19,870	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	239	327	9,850	112,883	家庭用品・パーソナル用品
BOLIDEN AB	—	162	4,012	45,986	素材
KINNEVIK AB-B SHS	—	112	2,468	28,290	各種金融
KINNEVIK AB-REDEMPTION SHARE	—	112	655	7,508	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	608	776	7,300	83,667	銀行
ASSA ABLOY AB-B	434	534	12,153	139,283	資本財
NORDEA BANK ABP	1,231	1,704	11,563	132,514	銀行
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	10,255 32	12,822 33	188,347 —	2,158,463 <0.9%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	406	510	7,906	94,091	銀行
TELENOR ASA	311	396	6,661	79,266	電気通信サービス
EQUINOR ASA	498	507	8,623	102,623	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	74	90	3,129	37,237	素材
MOWI ASA	169	222	5,084	60,505	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA	604	790	2,576	30,665	素材
AKER BP ASA	36	53	1,425	16,958	エネルギー
ORKLA ASA	339	339	3,027	36,024	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	69	110	1,919	22,840	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	37	39	933	11,111	メディア・娯楽
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	2,548 10	3,060 10	41,287 —	491,326 <0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B	46	58	5,675	91,765	食品・飲料・タバコ
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	2	3	3,506	56,705	運輸
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	1	1	1,479	23,919	運輸
DANSKE BANK A/S	297	327	3,002	48,544	銀行
GENMAB A/S	27	32	5,204	84,157	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	76	95	6,183	99,988	資本財
H LUNDBECK A/S	28	28	752	12,165	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DSV PANALPINA A S	75	116	8,620	139,398	運輸
PANDORA A/S	47	47	1,300	21,025	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	40	60	3,104	50,206	素材
NOVOZYMES A/S-B SHARES	85	102	3,307	53,475	素材
COLOPLAST-B	49	60	4,848	78,406	ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B	751	928	35,388	572,235	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S	64	85	1,326	21,451	商業・専門サービス
TRYG A/S	50	82	1,601	25,903	保険
ORSTED A/S	77	95	5,995	96,939	公益事業
DEMANT A/S	44	44	924	14,947	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	1,769 17	2,172 17	92,222 —	1,491,236 <0.6%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	61	95	694	51,548	ヘルスケア機器・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	1,202	1,466	3,643	270,493	銀行
AMCOR PLC-CDI	503	—	—	—	素材
WESTPAC BANKING CORPORATION	1,406	1,853	4,545	337,493	銀行

# 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	178	—	—	—	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	728	701	682	50,644	素材
TELSTRA CORPORATION LIMITED	1,697	2,169	837	62,176	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	198	198	199	14,776	銀行
COCA-COLA AMATIL LIMITED	168	234	266	19,807	食品・飲料・タバコ
ASX LTD	92	92	758	56,343	各種金融
BHP GROUP LTD	1,334	1,516	5,799	430,580	素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	99	133	462	34,349	エネルギー
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	205	205	88	6,558	小売
COMPUTERSHARE LIMITED	194	300	532	39,544	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED	185	234	6,650	493,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	17	28	299	22,246	メディア・娯楽
COCHLEAR LIMITED	21	29	684	50,852	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	745	893	776	57,689	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	724	920	7,438	552,345	銀行
BORAL LIMITED	422	753	387	28,774	素材
RIO TINTO LIMITED	165	197	1,914	142,126	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD	260	291	988	73,393	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	1,010	1,171	924	68,651	保険
TPG TELECOM LTD	177	177	124	9,216	電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	26	26	116	8,663	消費者サービス
ORICA LIMITED	179	179	427	31,748	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	230	230	335	24,943	素材
WORLEY LIMITED	—	133	200	14,906	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	523	639	855	63,515	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,114	1,532	3,966	294,524	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	313	412	1,270	94,310	素材
OIL SEARCH LTD	608	705	525	38,985	エネルギー
INCITEC PIVOT LTD	613	613	198	14,714	素材
AMP LIMITED	1,297	2,235	436	32,443	各種金融
QANTAS AIRWAYS LIMITED	—	458	334	24,841	運輸
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	582	670	849	63,083	保険
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	230	230	187	13,914	各種金融
SANTOS LTD	715	916	747	55,465	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	178	210	634	47,145	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTERSON	—	76	170	12,692	エネルギー
TABCORP HOLDINGS LIMITED	743	1,040	498	37,002	消費者サービス
WESFARMERS LIMITED	464	585	2,481	184,262	小売
ALUMINA LTD	1,069	1,069	247	18,348	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	381	501	1,729	128,428	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	556	677	2,694	200,039	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	80	424	31,545	各種金融
SEEK LIMITED	125	181	421	31,313	商業・専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	21	—	—	—	消費者サービス
BRAMBLES LIMITED	724	883	1,109	82,364	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD	130	169	2,333	173,269	各種金融
CROWN RESORTS LTD	165	218	282	20,957	消費者サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	186	258	749	55,616	素材
TREASURY WINE ESTATES LTD	319	364	681	50,629	食品・飲料・タバコ
AURIZON HOLDINGS LTD	868	868	502	37,287	運輸
HEALTHSCOPE LTD	760	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
AUSNET SERVICES	852	852	148	11,009	公益事業
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,287	1,287	419	31,158	保険
AGL ENERGY LIMITED	250	341	696	51,732	公益事業
SOUTH32 LTD	2,234	2,946	795	59,073	素材
CIMIC GROUP LTD	40	40	136	10,145	資本財
COLES GROUP LIMITED	464	574	934	69,412	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	
WISETECH GLOBAL LTD	—	79	215	16,019	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 銘柄 数 <比率>	30,067 57	35,962 58	67,460 —	5,008,931 <2.2%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LIMITED	198	211	318	22,509	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	319	349	541	38,267	食品・飲料・タバコ
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	219	306	677	47,872	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	310	406	212	15,022	素材
SPARK NEW ZEALAND LIMITED	798	878	399	28,185	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	—	302	145	10,246	公益事業
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	342	552	499	35,255	運輸
MERIDIAN ENERGY LTD	633	818	385	27,221	公益事業
小 計	株 数 銘柄 数 <比率>	2,822 7	3,825 8	3,179 —	224,581 <0.1%>
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	123	123	1,257	17,611	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	980	980	1,571	22,022	不動産
BANK OF EAST ASIA	528	872	1,540	21,579	銀行
CLP HOLDINGS LTD	661	851	6,867	96,214	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	478	606	14,980	209,874	各種金融
LI & FUNG LTD	2,372	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MTR CORPORATION	670	670	2,941	41,207	運輸
HANG LUNG GROUP LTD	420	—	—	—	不動産
HANG SENG BANK LTD	331	388	6,192	86,756	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	486	633	2,386	33,433	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	600	715	3,893	54,543	公益事業
WHARF HOLDINGS LTD	590	—	—	—	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	3,872	5,450	8,131	113,923	公益事業
HYSAN DEVELOPMENT CO	290	—	—	—	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	930	1,180	6,041	84,642	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	275	275	694	9,728	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,570	1,875	4,987	69,874	銀行
NWS HOLDINGS LTD	695	695	729	10,223	資本財
PCCW LIMITED	1,940	2,690	1,269	17,788	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDC	270	270	625	8,756	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	2,613	3,563	3,641	51,020	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD.	640	—	—	—	消費者サービス
SINO LAND CO	1,242	1,242	1,458	20,428	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	640	850	9,681	135,637	不動産
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	180	270	1,902	26,649	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	—	420	1,264	17,711	食品・飲料・タバコ
WHEELLOCK&COMPANY LTD	330	520	2,529	35,442	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	560	780	4,590	64,310	資本財
MINTH GROUP LTD	320	—	—	—	自動車・自動車部品
SJM HOLDINGS LIMITED	800	800	638	8,943	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	708	708	1,219	17,080	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	440	—	—	—	消費者サービス
AIA GROUP LTD	4,980	6,326	49,595	694,837	保険
SANDS CHINA LTD	936	1,356	5,017	70,290	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LIMITED	530	530	1,290	18,080	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	480	720	3,128	43,828	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	1,110	1,110	851	11,927	公益事業
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	650	1,813	25,407	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LIMITED	3,975	5,170	4,156	58,235	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,094	1,434	10,197	142,866	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	300	300	1,590	22,275	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,074	1,394	7,257	101,670	不動産
小 計	株 数 銘柄 数 <比率>	41,035 40	46,417 35	175,933 —	2,464,827 <1.1%>

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	683	991	409	32,828	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	3,536	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP HOLDINGS LTD	769	942	2,378	190,783	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	161	258	266	21,397	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	47	47	144	11,550	小売
SATS LTD	268	268	133	10,705	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	356	356	315	25,270	各種金融
CAPITALAND LTD	1,045	1,366	502	40,320	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	711	1,167	274	21,997	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD	250	250	230	18,476	運輸
UNITED OVERSEAS BANK LTD	546	639	1,649	132,338	銀行
UOL GROUP LIMITED	217	217	168	13,506	不動産
VENTURE CORP LTD	119	119	188	15,147	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	563	690	151	12,184	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,349	4,391	1,484	119,048	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	437	437	95	7,679	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,268	1,762	1,899	152,353	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD	699	1,170	478	38,382	食品・飲料・タバコ
KEPPEL CORP LTD	586	699	469	37,676	資本財
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	900	900	92	7,435	資本財
GENTING SINGAPORE LTD	2,807	3,702	342	27,466	消費者サービス
小計	株数 19,318	株数 20,372	外貨建金額 11,676	邦貨換算金額 936,553	
	銘柄数 21	銘柄数 20		<比率> <0.4%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
BANK HAPAOALIM BM	440	650	1,797	56,738	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	655	839	2,091	66,005	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	1,001	—	—	—	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	8	13	784	24,772	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	—	546	869	27,435	銀行
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	287	287	458	14,461	素材
NICE LTD	27	27	1,439	45,426	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	54	54	495	15,629	銀行
AZRIELI GROUP	21	21	583	18,417	不動産
小計	株数 2,496	株数 2,441	外貨建金額 8,519	邦貨換算金額 268,887	
	銘柄数 8	銘柄数 8		<比率> <0.1%>	
合計	株数 505,064	株数 612,636	外貨建金額 —	邦貨換算金額 221,190,960	
	銘柄数 1,250	銘柄数 1,260		<比率> <95.2%>	

※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。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※-印は組入れなし。

※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。

※一部の銘柄において、資産区分を変更しております。

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	千米ドル	千円	%	
AGNC INVESTMENT CORPORATION	17,476	25,432	440	48,312	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,326	5,727	930	102,084	0.0	
AMERICAN TOWER CORP	18,353	23,336	4,994	547,808	0.2	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	51,312	80,296	749	82,168	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,571	7,069	1,515	166,238	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	6,157	7,835	1,085	119,053	0.1	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	11,010	—	—	—	—	
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	4,902	546	59,975	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	8,532	10,561	1,277	140,100	0.1	
DUKE REALTY CORP	13,732	20,240	712	78,096	0.0	
EQUINIX INC	—	4,426	2,508	275,173	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	—	8,664	641	70,395	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	14,828	18,789	1,598	175,372	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,713	3,332	1,040	114,087	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	6,463	685	75,174	0.0	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	4,227	558	61,229	0.0	
HCP, INC.	20,162	—	—	—	—	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	24,237	845	92,721	0.0	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	37,569	657	72,068	0.0	
INVITATION HOMES INC	14,734	30,069	918	100,686	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	12,165	16,395	526	57,758	0.0	
KIMCO REALTY CORPORATION	15,666	21,090	455	50,010	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	9,193	566	62,130	0.0	
MACERICH COMPANY/THE	3,806	—	—	—	—	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	29,675	616	67,568	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	5,780	786	86,286	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	8,249	459	50,430	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	—	12,872	541	59,337	0.0	
PROLOGIS INC	25,652	33,100	3,030	332,363	0.1	
PUBLIC STORAGE	6,516	7,965	1,678	184,050	0.1	
REALTY INCOME CORPORATION	11,714	16,047	1,229	134,871	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	6,080	9,451	614	67,419	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	3,945	3,945	336	36,921	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	12,869	16,451	2,487	272,835	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	—	4,598	757	83,064	0.0	
UDR INC	10,651	14,289	686	75,304	0.0	
VENTAS INC	14,830	20,469	1,193	130,908	0.1	

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘 柄	期首 (前期末)		期 末		組 入 比 率	
	口 数	口 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
VEREIT INC	44,740	54,273	529	58,097	0.0	
VICI PROPERTIES INC	—	26,533	656	71,967	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	7,603	8,706	562	61,656	0.0	
WP CAREY INC	6,694	8,640	720	79,051	0.0	
WELLTOWER INC	14,980	20,533	1,736	190,456	0.1	
WEYERHAEUSER CO	30,388	37,766	1,114	122,235	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	480,195	709,194	42,993	4,715,477	
	銘 柄 数 <比 率>	36	40	—	<2.0%>	
<b>(カナダ)</b>			千カナダドル			
CAN APARTMENT PROP	—	4,697	260	21,514	0.0	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,825	10,391	224	18,526	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	7,441	201	16,685	0.0	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	3,585	114	9,487	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	14,851	26,114	801	66,212	
	銘 柄 数 <比 率>	3	4	—	<0.0%>	
<b>(ユーロ・・・フランス)</b>			千ユーロ			
ICADE	1,265	1,265	114	13,889	0.0	
KLEPIERRE	9,305	9,305	303	36,628	0.0	
GECINA SA	1,738	2,689	421	50,958	0.0	
COVIVIO	1,550	2,388	239	28,976	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	5,937	7,311	1,037	125,383	0.1	
ユーロ計	口 数 ・ 金 額	19,795	22,958	2,116	255,837	
	銘 柄 数 <比 率>	5	5	—	<0.1%>	
<b>(イギリス)</b>			千英ポンド			
BRITISH LAND CO PLC	34,772	44,962	258	36,643	0.0	
HAMMERSON PLC	34,414	—	—	—	—	
SEGRO PLC	40,873	61,311	548	77,608	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	32,703	313	44,377	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	142,762	138,976	1,120	158,629	
	銘 柄 数 <比 率>	4	3	—	<0.1%>	
<b>(オーストラリア)</b>			千オーストラリアドル			
MIRVAC GROUP	140,993	226,368	762	56,642	0.0	
TRANSURBAN GROUP	104,775	141,455	2,171	161,221	0.1	
APA GROUP	48,387	67,160	738	54,852	0.0	
GPT GROUP	69,713	97,296	598	44,429	0.0	
LENDLEASE GROUP	25,262	25,262	487	36,219	0.0	
STOCKLAND	103,417	103,417	522	38,777	0.0	
DEXUS	38,051	62,385	762	56,650	0.0	
GOODMAN GROUP	64,265	86,301	1,278	94,964	0.0	

## 外国株式インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首 (前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評 価 額		組 入 比 率
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		49,760	49,760			456	33,917	0.0
		234,290	290,995			1,146	85,129	0.0
		146,656	146,656			393	29,183	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,025,569 11	1,297,055 11			9,319 -	691,987 <0.3%>	
<b>(香港)</b>						千香港ドル		
		92,500	112,500			9,000	126,090	0.1
		136,000	170,000			1,951	27,341	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	228,500 2	282,500 2			10,951 -	153,431 <0.1%>	
<b>(シンガポール)</b>						千シンガポールドル		
		102,800	160,800			405	32,502	0.0
		118,300	150,400			448	35,949	0.0
		130,000	130,400			262	21,023	0.0
		65,600	64,600			118	9,534	0.0
		-	104,900			247	19,857	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	416,700 4	611,100 5			1,481 -	118,866 <0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,328,372 65	3,087,897 70			- -	6,160,443 <2.7%>	

※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。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※-印は組入れなし。

※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 国	株 式 先 物 取 引			百万円		百万円
		S P I 2 0 0		216		-
		D J E U R O		827		-
		F T S E		281		-
		S P M I N I		3,534		-

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※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。

※-印は組入れなし。

# 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

(2019年12月2日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	221,190,960	95.1
投 資 証 券	6,160,443	2.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,346,121	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	232,697,524	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※期末における外貨建資産（232,363,571千円）の投資信託財産総額（232,697,524千円）に対する比率は99.9%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.68円、1カナダドル=82.62円、1ユーロ=120.86円、1英ポンド=141.59円、1スイスフラン=109.59円、1スウェーデンクローナ=11.46円、1ノルウェークローネ=11.90円、1デンマーククローネ=16.17円、1オーストラリアドル=74.25円、1ニュージーランドドル=70.63円、1香港ドル=14.01円、1シンガポールドル=80.21円、1イスラエルシェケル=31.56円です。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月2日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	232,939,548,805円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,229,184,929
株 式(評価額)	221,190,960,865
投 資 証 券(評価額)	6,160,443,382
未 収 入 金	318,051,486
未 収 配 当 金	388,775,579
差 入 委 託 証 拠 金	1,652,132,564
(B) 負 債	520,629,054
未 払 金	331,083,940
未 払 解 約 金	189,530,582
未 払 利 息	469
そ の 他 未 払 費 用	14,063
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	232,418,919,751
元 本	59,882,488,969
次 期 繰 越 損 益 金	172,536,430,782
(D) 受 益 権 総 口 数	59,882,488,969口
1万口当たり基準価額(C/D)	38,813円

※当期における期首元本額50,246,578,230円、期中追加設定元本額25,475,610,485円、期中一部解約元本額15,839,699,746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2018年12月1日 至2019年12月2日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,142,999,222円
受 取 配 当 金	4,118,511,245
受 取 利 息	7,980,013
そ の 他 収 益 金	16,811,889
支 払 利 息	△ 303,925
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	18,409,509,351
売 買 益 損	29,830,623,457
売 買 損 益	△ 11,421,114,106
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	689,302,248
取 引 益 損	1,248,893,389
取 引 損 益	△ 559,591,141
(D) 信 託 報 酬 等	△ 86,588,797
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	23,155,222,024
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	123,998,809,377
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	65,355,675,104
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 39,973,275,723
(I) 計 (E+F+G+H)	172,536,430,782
次 期 繰 越 損 益 金(I)	172,536,430,782

※有価証券売買損益および先物取引等取引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	24,341,482,029円	SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,425,257,649円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	309,208,928円	SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,437,712,637円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,259,261,163円	SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,008,822,640円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	846,574,484円	SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	20,208,409円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	95,225,173円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	101,561,964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)	2,203,478円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	419,448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)	8,569,298円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	719,013,252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)	23,404,360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>	59,112,177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)	49,150,528円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	171,173,908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)	35,973,195円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	746,604,437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)	84,418,147円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	610,403,231円
外国株式指数ファンド	519,424,273円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,481,526,688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	4,651,861,582円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	807,485円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	467,864,523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)	298,971,151円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	467,950,368円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	124,994,236円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	363,716,897円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	17,270,683円
イオン・バランス戦略ファンド	12,835,702円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	12,728,159円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,924,395円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	6,672,335円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	38,804,550円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	41,560,678円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	35,331,600円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	104,386,931円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	98,630,259円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	7,900,647円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	53,111,115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>	824,759,297円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	67,295,491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>	136,799,749円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	18,283,485円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,661,668,736円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	280,003円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	253,114,771円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	27,790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>	3,894,611,777円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	41,770円	SMAM・年金ワリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	8,907,868円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	56,291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>	45,206,401円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,410,498,405円	SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	27,976,493円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	7,831,278円	SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	282,124,598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>	73,969,974円		

### ■ お知らせ

#### <約款変更について>

・委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
(適用日：2019年4月1日)

# SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド 〈適格機関投資家限定〉

(2018年12月18日から2019年12月17日まで)

第 16 期

決算日 2019年12月17日

## ■当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2003年12月18日）
運用方針	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た運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドおよびベンチマーク採用国の国債等を主要投資対象とします。 外国債券パッシブ・マザーファンド ベンチマーク採用国の国債
当ファンドの運用方法	■ベンチマーク採用国の国債等に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ■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を最小化します。 ■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す。 ■保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 外国債券パッシブ・マザーファンド ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	年1回（毎年12月17日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、次の方針に基づき分配します。 ■分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みません。）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。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

## ■ 1万口当たりの費用明細(2018年12月18日から2019年12月17日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	12円	0.066%	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)
(投信会社)	(2)	(0.009)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(2)	(0.013)	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)	(8)	(0.044)	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) その他費用	8	0.043	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)	(6)	(0.037)	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)	(0.005)	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)	(0.001)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	20	0.109	

期中の平均基準価額は17,566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。

※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。

## ■ 当期中の売買及び取引の状況(2018年12月18日から2019年12月17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
外国債券パッシブ・マザーファンド	千口 1,965,870	千円 3,501,340	千口 1,433,376	千円 2,492,588

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ■ 組入れ資産の明細(2019年12月17日現在)

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期	末
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券パッシブ・マザーファンド	千口 2,126,900	千口 2,659,394	千円 4,852,863

※外国債券パッシブ・マザーファンドの期末の受益権総口数は94,197,787千口です。

※単位未満は切捨て。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月17日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	4,854,803,433円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	9,963
外 国 債 券 パ ッ シ ブ ・ マ ザ ー フ ァ ン ド ( 評 価 額 )	4,852,863,474
未 収 入 金	1,929,996
(B) 負 債	3,070,286
未 払 解 約 金	1,929,996
未 払 信 託 報 酬	1,052,627
そ の 他 未 払 費 用	87,663
(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )	4,851,733,147
元 本	2,686,779,565
次 期 繰 越 損 益 金	2,164,953,582
(D) 受 益 権 総 口 数	2,686,779,565口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 ( C / D )	18,058円

※当期における期首元本額2,147,006,651円、期中追加設定元本額1,986,558,681円、期中一部解約元本額1,446,785,767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2018年12月18日 至2019年12月17日)

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	131,499,688円
売 買 損 益	150,463,215
売 買 損 益	△ 18,963,527
(B) 信 託 報 酬 等	△ 2,328,965
(C) 当 期 損 益 金 ( A + B )	129,170,723
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	115,826,659
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,919,956,200
( 配 当 等 相 当 額 )	( 2,784,317,085)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 864,360,885)
(F) 計 ( C + D + E )	2,164,953,582
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 ( F + G )	2,164,953,582
追 加 信 託 差 損 益 金	1,919,956,200
( 配 当 等 相 当 額 )	( 2,787,415,456)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 867,459,256)
分 配 準 備 積 立 金	313,178,288
繰 越 損 益 金	△ 68,180,906

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※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。

※期末における、費用控除後の配当等収益(77,664,725円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,787,415,456円)および分配準備積立金(235,513,563円)より分配可能額は3,100,593,744円(1万口当たり11,540円)ですが、分配は行っておりません。

# 外国債券パッシブ・マザーファンド

第16期（2018年12月18日から2019年12月17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>

## ■ 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)		債 券 組 入 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率		
12期 (2015年12月17日)	円 18,044	△1.6%	182.96	△1.4%	98.5%	百万円 198,255
13期 (2016年12月19日)	17,116	△5.1	172.59	△5.7	98.4	180,203
14期 (2017年12月18日)	17,897	4.6	181.01	4.9	98.9	196,212
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

※ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、前日の指数を当日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、設定時を100として2019年12月17日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

※ F T S E 世界国債インデックス（除く日本）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

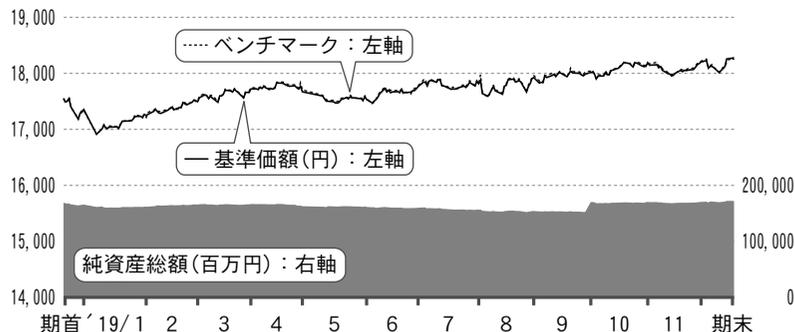
年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) F T S E 世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		債 券 組 入 率 比
	騰 落 率	率	騰 落 率	率	
(期 首) 2018年12月17日	円 17,553	—	177.36	—	98.7%
12月末	17,355	△1.1	175.20	△1.2	98.7
2019年1月末	17,249	△1.7	173.91	△1.9	98.8
2月末	17,495	△0.3	176.93	△0.2	98.2
3月末	17,722	1.0	179.31	1.1	98.8
4月末	17,671	0.7	178.91	0.9	98.4
5月末	17,533	△0.1	177.32	△0.0	98.9
6月末	17,763	1.2	179.64	1.3	99.1
7月末	17,814	1.5	180.05	1.5	98.8
8月末	17,925	2.1	181.49	2.3	98.8
9月末	18,017	2.6	182.32	2.8	98.5
10月末	18,192	3.6	183.72	3.6	98.1
11月末	18,202	3.7	184.08	3.8	98.5
(期 末) 2019年12月17日	18,248	4.0	184.64	4.1	98.6

※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（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

### 基準価額等の推移



期首	17,553円
期末	18,248円
騰落率	+4.0%

※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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

※FTSE世界国債インデックス（除く日本）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（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の公社債に分散投資し、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）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	・FRB（米連邦準備制度理事会）が保険的な利下げを実施するなど、ハト派（景気を重視する立場）的な金融政策に転換したことにより、米国金利が低下したこと
下落要因	・景気見通しに対する不透明感や投資家のリスク回避的な姿勢などから、円が対ドルや対ユーロで上昇したこと

### ▶ 投資環境について（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

長期金利は米国、欧州（ドイツ）ともに低下（債券価格は上昇）しました。為替市場では、米ドルやユーロは対円で下落しました。

#### 債券市場

米国では、期初からもみ合い推移が続いた後、2019年3月のFOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利の見通しが大幅に引き下げられると、年内の利下げを織り込む形で金利が低下しました。その後、5月にトランプ大統領が中国に対する関税引上げを実施し、8月にも中国に対する追加関税が発表されるなど、米中通商摩擦に対する不透明感から金利は大きく低下しました。7月末にグローバルな景気見通しの悪化を受けてFRBが保険的な利下げを実施したことも、金利低下要因になりました。その後、米中協議の再開を受けて、米中間の対立先鋭化に対する警戒感が後退し、10月に金利は上昇に転じ、期末まで上昇基調で推移しました。

欧州では、域内の経済指標の低迷や、ECB（欧州中央銀行）が金利据え置き期間を長期化するなどハト派的な姿勢を示したことから、期首から8月にかけて金利低下が進行しました。ECBは9月に政策金利の引下げと量的緩和を含む金融緩和策を発表しました。ドイツの財政支出拡大観測や米中通商協議の進展に対する期待から、9月以降、金利は上昇に転じ、期末にかけて上昇傾向が続きました。

当期の市場の動きを米国10年国債利回りで見ると、期首2.89%から期末1.87%へと低下し、ドイツ10年国債利回りで見ると、期首0.25%から期末-0.28%へと低下しました。

#### 為替市場

米ドル・円は、期初は株式市場の下落を受けてリスク回避の動きが強まるなか、円高が進行しましたが、2019年1月中旬以降は、米国の利上げ停止観測などを受けたリスク選好度の改善とともに、米ドルが反発しました。5月以降は、米中通商協議に対する警戒感が高まると、円が強含みで推移しました。10月から期末にかけては、米国金利の上昇に連れて米ドル高・円安基調となりました。

ユーロ・円は、期初から8月にかけて、投資家のリスク回避姿勢の強まりと欧州景気の低迷から、円高傾向となりました。その後は英国のEU（欧州連合）からの離脱交渉が進展するなどリスク選好度の改善とともにユーロが反発に転じ、期末までユーロ高・円安となりました。

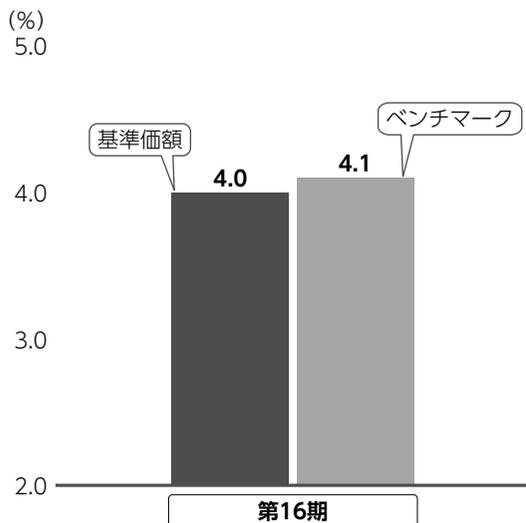
当期の米ドル・円は、期首113円47銭から期末109円56銭と3円91銭の米ドル安・円高、ユーロ・円は期首128円28銭から期末122円01銭と6円27銭のユーロ安・円高となりました。

▶ポートフォリオについて（2018年12月18日から2019年12月17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（2018年12月18日から2019年12月17日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



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】

当期における基準価額の騰落率は+4.0%となり、ベンチマークの騰落率+4.1%を0.1%下方乖離しました。

下方乖離要因

・カストディフィーやポートフォリオの維持のための売買コストが生じたこと

## 2 今後の運用方針

米国では、景気に底入れの兆候が見られるものの、F R Bは慎重なスタンスを継続する見通しです。インフレ環境が抑制されていることから、長期金利は低位での推移を予想します。ユーロ圏でも、景気の底入れが見込まれる一方で、低インフレ環境やE C Bの緩和政策が続くことから、金利は低位での推移を予想します。

為替相場は、米ドル・円では、日米金利差は米ドルの支援材料ですが、F R Bの慎重な姿勢を背景にレンジ相場を予想します。ユーロ・米ドルに関しても、米国、ユーロ圏ともに慎重な金融政策が継続することから、レンジ相場を予想します。

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、迅速なリバランスを行います。

## 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 (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) そ の 他 費 用	7円	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入金・資産の移転等に要する費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
（保 管 費 用）	(7)	(0.037)	
（そ の 他）	(0)	(0.001)	
合 計	7	0.038	

期中の平均基準価額は17,744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 (2018年12月18日から2019年12月17日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 237,118	千米ドル 211,041
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 14,012	千カナダドル 15,881
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 89,136	千メキシコペソ 89,554
	ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
	ド イ ツ	国 債 証 券	20,446	30,435
	イ タ リ ア	国 債 証 券	30,062	31,992
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	41,083	35,251
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	4,653	6,453
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	16,882	22,494
	ベルギー	国 債 証 券	6,308	5,023
	オーストリア	国 債 証 券	4,238	3,509
	フィンランド	国 債 証 券	2,223	725
アイルランド	国 債 証 券	1,637	2,094	
国	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千英ポンド 17,673	千英ポンド 22,451
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 7,478	千スウェーデンクローナ 7,012

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

			買 付 額	売 付 額
外	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 4,912	千ノルウェークローネ 3,486
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 7,725	千デンマーククローネ 8,503
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 6,066	千ポーランドズロチ 6,826
国	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 6,849	千オーストラリアドル 8,893
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 2,281	千シンガポールドル 1,898
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリングgit 10,439	千マレーシアリングgit 10,746
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 24,197	千南アフリカランド 17,148

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2018年12月18日から2019年12月17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 (2018年12月18日から2019年12月17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 (2019年12月17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	千米ドル 711,170	千米ドル 741,288	千円 81,215,588	%	%	%	%	%
カナダ	千カナダドル 35,500	千カナダドル 38,573	3,209,295	1.9	-	0.9	0.7	0.3

## 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
メ キ シ コ	千メキシコペソ 241,000	千メキシコペソ 257,176	1,486,478	0.9	—	0.5	0.4	—
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	63,000	78,385	9,563,778	5.6	—	3.9	1.2	0.5
イ タ リ ア	109,120	125,910	15,362,296	8.9	—	5.1	2.7	1.1
フ ラ ン ス	117,270	140,636	17,159,073	10.0	—	6.6	2.4	1.0
オ ラ ン ダ	21,400	25,565	3,119,239	1.8	—	1.1	0.6	0.1
ス ペ イ ン	61,550	75,673	9,232,969	5.4	—	3.5	1.4	0.4
ベ ル ギ ー	27,450	34,658	4,228,633	2.5	—	1.7	0.4	0.3
オーストリア	17,750	21,765	2,655,644	1.5	—	1.1	0.4	0.1
フィンランド	9,000	10,106	1,233,111	0.7	—	0.4	0.3	0.1
アイルランド	9,200	10,745	1,311,063	0.8	—	0.6	0.2	—
イ ギ リ ス	千英ポンド 58,020	千英ポンド 75,864	11,035,227	6.4	—	5.1	1.1	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 43,800	千スウェーデンクローナ 49,622	580,091	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 31,200	千ノルウェークローネ 32,213	391,397	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 41,100	千デンマーククローネ 53,848	879,343	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 31,900	千ポーランドズロチ 34,087	976,939	0.6	—	0.3	0.1	0.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 38,250	千オーストラリアドル 43,919	3,307,106	1.9	—	1.3	0.5	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 8,050	千シンガポールドル 8,775	709,066	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 28,200	千マレーシアリンギット 29,136	770,358	0.4	—	0.3	0.1	—
南アフリカ	千南アフリカランド 162,500	千南アフリカランド 132,294	1,006,764	0.6	—	0.5	—	0.1
合 計	—	—	169,433,468	98.6	—	53.8	30.1	14.6

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

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

## 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

種	類	銘	柄	期			末													
				利	率	額	評		額	償										
							外	貨			建	換	算	金	額	還	年	月	日	
				%	千	米	ド	千	米	ド	千	円								
(アメリカ)	国債証券	US TREASURY N/B 1.125		1.125	3,800	3,774	413,530						2021/2/28							
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	3,000	2,974	325,906						2021/6/30							
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	4,500	4,458	488,474						2021/7/31							
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	2,700	2,673	292,946						2021/8/31							
		US TREASURY N/B 1.125		1.125	2,100	2,079	227,775						2021/9/30							
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	3,600	3,579	392,197						2021/3/31							
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	4,500	4,463	489,014						2021/10/31							
		US TREASURY N/B 1.25		1.25	3,000	2,952	323,493						2023/7/31							
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	2,989	327,550						2021/1/31							
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	2,400	2,389	261,814						2021/4/30							
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	4,000	3,981	436,219						2021/5/31							
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	4,000	3,966	434,610						2022/10/15							
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,500	3,460	379,176						2023/6/30							
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	2,500	2,470	270,626						2023/8/31							
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	3,000	2,962	324,622						2023/9/30							
		US TREASURY N/B 1.375		1.375	2,600	2,526	276,777						2026/8/31							
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	2,989	327,575						2022/1/31							
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	5,800	5,774	632,618						2022/9/15							
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	2,982	326,754						2023/2/28							
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	3,000	2,982	326,754						2023/3/31							
		US TREASURY N/B 1.5		1.5	1,500	1,469	161,001						2026/8/15							
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,500	3,498	383,250						2020/11/30							
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	2,000	1,997	218,897						2022/8/15							
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,400	3,395	372,038						2022/8/31							
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,500	3,494	382,830						2022/11/15							
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,000	2,993	327,961						2023/4/30							
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,000	2,992	327,858						2023/5/31							
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	3,000	2,990	327,652						2023/10/31							
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	2,400	2,374	260,129						2026/2/15							
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	6,050	5,980	655,225						2026/5/15							
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	5,500	5,429	594,812						2026/9/30							
		US TREASURY N/B 1.625		1.625	9,650	9,420	1,032,144						2029/8/15							
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	2,000	2,001	219,274						2020/12/31							
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	10,500	10,507	1,151,188						2021/7/31							
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,004	329,142						2021/11/30							
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,005	329,296						2022/2/28							
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	1,800	1,803	197,577						2022/3/31							
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	2,400	2,404	263,457						2022/4/30							
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	4,100	4,108	450,108						2022/5/15							
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,006	329,347						2022/5/31							
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,006	329,373						2022/6/30							

## 外国債券パッシブ・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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,005	329,296	2022/ 9 /30
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	3,000	3,006	329,347	2023/ 1 /31
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	5,700	5,709	625,516	2023/ 5 /15
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	11,800	11,809	1,293,818	2024/ 6 /30
		US TREASURY N/B 1.75		1.75	850	850	93,184	2024/ 7 /31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	2,400	2,409	264,012	2022/ 1 /31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	2,000	2,008	220,095	2022/ 3 /31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	3,000	3,014	330,220	2022/ 4 /30
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	3,000	3,015	330,349	2022/ 5 /31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	1,700	1,708	187,183	2022/ 7 /31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	4,800	4,825	528,640	2022/ 8 /31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	3,000	3,016	330,451	2022/10/31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	1,800	1,810	198,409	2024/ 8 /31
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	3,500	3,512	384,778	2026/ 6 /30
		US TREASURY N/B 1.875		1.875	3,200	3,210	351,769	2026/ 7 /31
		US TREASURY N/B 2		2.0	5,300	5,315	582,391	2020/11/30
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,000	3,010	329,784	2021/ 1 /15
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,000	3,011	329,886	2021/ 2 /28
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,000	3,013	330,143	2021/ 5 /31
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,000	3,015	330,400	2021/ 8 /31
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,000	3,017	330,554	2021/10/31
		US TREASURY N/B 2		2.0	4,300	4,327	474,089	2021/11/15
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,500	3,521	385,856	2021/12/31
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,100	3,121	341,997	2022/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,000	3,024	331,401	2022/ 7 /31
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,500	3,531	386,905	2022/10/31
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,000	3,027	331,658	2022/11/30
		US TREASURY N/B 2		2.0	5,500	5,552	608,370	2023/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2		2.0	2,000	2,022	221,602	2024/ 4 /30
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,300	3,338	365,756	2024/ 5 /31
		US TREASURY N/B 2		2.0	2,500	2,528	277,024	2024/ 6 /30
		US TREASURY N/B 2		2.0	3,500	3,541	387,983	2025/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2		2.0	4,300	4,349	476,555	2025/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2		2.0	7,000	7,077	775,428	2026/11/15
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	2,700	2,712	297,198	2021/ 1 /31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	1,700	1,711	187,474	2021/ 6 /30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	4,000	4,028	441,355	2021/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,000	3,022	331,145	2021/ 9 /30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,000	3,026	331,581	2021/12/31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	4,500	4,547	498,219	2022/ 5 /15
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,000	3,034	332,429	2022/ 6 /30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	4,000	4,052	443,991	2022/12/31
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	3,100	3,147	344,863	2023/11/30
		US TREASURY N/B 2.125		2.125	2,000	2,031	222,612	2024/ 2 /29

## 外国債券パッシブ・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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		US TREASURY N/B 2. 125		2. 125	6, 500	6, 606	723, 767	2024/ 3 /31
		US TREASURY N/B 2. 125		2. 125	3, 500	3, 559	389, 990	2024/ 7 /31
		US TREASURY N/B 2. 125		2. 125	4, 000	4, 069	445, 874	2024/ 9 /30
		US TREASURY N/B 2. 125		2. 125	1, 800	1, 831	200, 705	2024/11/30
		US TREASURY N/B 2. 125		2. 125	4, 900	4, 989	546, 616	2025/ 5 /15
		US TREASURY N/B 2. 125		2. 125	5, 700	5, 806	636, 152	2026/ 5 /31
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	4, 000	4, 025	441, 047	2021/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	3, 000	3, 021	330, 991	2021/ 3 /31
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	4, 500	4, 533	496, 640	2021/ 4 /30
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	2, 800	2, 824	309, 404	2021/ 7 /31
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	4, 300	4, 356	477, 254	2022/ 4 /15
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	3, 000	3, 061	335, 459	2023/12/31
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	5, 200	5, 308	581, 551	2024/ 1 /31
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	4, 800	4, 904	537, 309	2024/ 4 /30
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	1, 500	1, 535	168, 230	2024/10/31
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	6, 300	6, 448	706, 459	2024/11/15
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	3, 100	3, 174	347, 808	2024/12/31
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	4, 000	4, 100	449, 298	2025/11/15
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	7, 200	7, 387	809, 415	2026/ 3 /31
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	4, 400	4, 525	495, 772	2027/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	5, 200	5, 351	586, 358	2027/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	5, 600	5, 764	631, 558	2027/11/15
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	2, 850	2, 813	308, 196	2046/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2. 25		2. 25	4, 500	4, 440	486, 472	2049/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2. 375		2. 375	2, 000	2, 014	220, 694	2020/12/31
		US TREASURY N/B 2. 375		2. 375	5, 000	5, 042	552, 507	2021/ 3 /15
		US TREASURY N/B 2. 375		2. 375	2, 000	2, 017	221, 071	2021/ 4 /15
		US TREASURY N/B 2. 375		2. 375	3, 600	3, 656	400, 609	2022/ 3 /15
		US TREASURY N/B 2. 375		2. 375	1, 200	1, 224	134, 204	2023/ 1 /31
		US TREASURY N/B 2. 375		2. 375	3, 700	3, 797	416, 013	2024/ 2 /29
		US TREASURY N/B 2. 375		2. 375	5, 600	5, 756	630, 695	2024/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2. 375		2. 375	4, 900	5, 084	557, 101	2027/ 5 /15
		US TREASURY N/B 2. 375		2. 375	6, 200	6, 458	707, 557	2029/ 5 /15
		US TREASURY N/B 2. 375		2. 375	700	709	77, 782	2049/11/15
		US TREASURY N/B 2. 5		2. 5	8, 900	8, 986	984, 530	2021/ 2 /28
		US TREASURY N/B 2. 5		2. 5	1, 900	1, 931	211, 611	2022/ 1 /15
		US TREASURY N/B 2. 5		2. 5	3, 500	3, 560	390, 140	2022/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2. 5		2. 5	5, 000	5, 139	563, 078	2023/ 8 /15
		US TREASURY N/B 2. 5		2. 5	5, 700	5, 883	644, 641	2024/ 5 /15
		US TREASURY N/B 2. 5		2. 5	4, 600	4, 768	522, 481	2025/ 1 /31
		US TREASURY N/B 2. 5		2. 5	1, 400	1, 456	159, 603	2026/ 2 /28
		US TREASURY N/B 2. 5		2. 5	4, 100	4, 248	465, 514	2045/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2. 5		2. 5	2, 900	3, 006	329, 365	2046/ 2 /15
		US TREASURY N/B 2. 5		2. 5	4, 100	4, 252	465, 900	2046/ 5 /15

## 外国債券パッシブ・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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	1,500	1,513	165,765	2020/11/15
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	500	506	55,494	2021/5/15
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	4,000	4,055	444,300	2021/6/15
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	4,000	4,057	444,573	2021/7/15
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	3,000	3,056	334,842	2021/12/15
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	4,000	4,116	450,976	2023/2/28
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	4,300	4,487	491,608	2025/3/31
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	5,800	6,072	665,333	2025/12/31
		US TREASURY N/B 2.625		2.625	6,300	6,691	733,097	2029/2/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	4,000	4,068	445,772	2021/8/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	1,400	1,425	156,152	2021/9/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	4,900	5,068	555,339	2023/4/30
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	2,000	2,072	227,097	2023/7/31
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	5,000	5,185	568,171	2023/8/31
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	6,200	6,439	705,540	2023/11/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	5,100	5,308	581,586	2024/2/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	2,000	2,098	229,921	2025/2/28
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	5,000	5,256	575,874	2025/6/30
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	600	631	69,171	2025/8/31
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	4,800	5,124	561,385	2028/2/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	2,000	2,164	237,163	2042/8/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	2,800	3,028	331,764	2042/11/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	3,800	4,138	453,439	2047/8/15
		US TREASURY N/B 2.75		2.75	1,500	1,634	179,079	2047/11/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	4,000	4,089	447,997	2021/11/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	5,000	5,216	571,509	2023/10/31
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	2,000	2,088	228,792	2023/11/30
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	2,200	2,324	254,721	2025/4/30
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	1,100	1,162	127,417	2025/5/31
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	2,500	2,651	290,526	2025/11/30
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	4,500	4,853	531,768	2028/5/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	7,000	7,560	828,273	2028/8/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	3,000	3,314	363,088	2043/5/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	4,000	4,438	486,275	2045/8/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	3,600	4,008	439,219	2046/11/15
		US TREASURY N/B 2.875		2.875	900	1,008	110,444	2049/5/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	4,000	4,266	467,444	2025/9/30
		US TREASURY N/B 3		3.0	3,100	3,307	362,402	2025/10/31
		US TREASURY N/B 3		3.0	1,800	2,026	222,074	2042/5/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	4,000	4,525	495,861	2044/11/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	4,000	4,534	496,786	2045/5/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	4,200	4,768	522,488	2045/11/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	2,500	2,851	312,374	2047/2/15
		US TREASURY N/B 3		3.0	2,200	2,508	274,795	2047/5/15

## 外国債券パッシブ・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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		US TREASURY N/B 3	3.0	3,100	3,542	388,113	2048/2/15	
		US TREASURY N/B 3	3.0	7,400	8,466	927,605	2048/8/15	
		US TREASURY N/B 3	3.0	3,800	4,353	477,020	2049/2/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	3,000	3,060	335,253	2021/5/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	6,700	7,383	808,948	2028/11/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	1,100	1,263	138,405	2041/11/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	2,000	2,297	251,679	2042/2/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	2,300	2,643	289,589	2043/2/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	3,800	4,385	480,468	2044/8/15	
		US TREASURY N/B 3.125	3.125	2,400	2,805	307,315	2048/5/15	
		US TREASURY N/B 3.375	3.375	4,000	4,803	526,298	2044/5/15	
		US TREASURY N/B 3.375	3.375	3,100	3,797	416,080	2048/11/15	
		US TREASURY N/B 3.5	3.5	800	968	106,156	2039/2/15	
		US TREASURY N/B 3.625	3.625	5,000	5,110	559,911	2021/2/15	
		US TREASURY N/B 3.625	3.625	3,400	4,225	462,923	2043/8/15	
		US TREASURY N/B 3.625	3.625	3,600	4,483	491,201	2044/2/15	
		US TREASURY N/B 3.75	3.75	1,500	1,884	206,477	2041/8/15	
		US TREASURY N/B 3.75	3.75	4,000	5,067	555,229	2043/11/15	
		US TREASURY N/B 3.875	3.875	1,500	1,912	209,494	2040/8/15	
		US TREASURY N/B 4.25	4.25	1,000	1,330	145,757	2039/5/15	
		US TREASURY N/B 4.25	4.25	600	803	87,978	2040/11/15	
		US TREASURY N/B 4.375	4.375	500	671	73,572	2038/2/15	
		US TREASURY N/B 4.375	4.375	700	947	103,809	2039/11/15	
		US TREASURY N/B 4.375	4.375	1,400	1,901	208,374	2040/5/15	
		US TREASURY N/B 4.375	4.375	1,800	2,453	268,834	2041/5/15	
		US TREASURY N/B 4.5	4.5	750	1,002	109,806	2036/2/15	
		US TREASURY N/B 4.5	4.5	200	272	29,896	2038/5/15	
		US TREASURY N/B 4.5	4.5	1,000	1,372	150,396	2039/8/15	
		US TREASURY N/B 4.625	4.625	4,200	5,871	643,278	2040/2/15	
		US TREASURY N/B 4.75	4.75	1,500	2,139	234,377	2041/2/15	
		US TREASURY N/B 5	5.0	500	714	78,258	2037/5/15	
		US TREASURY N/B 5.25	5.25	500	638	69,964	2028/11/15	
		US TREASURY N/B 5.375	5.375	320	431	47,253	2031/2/15	
		US TREASURY N/B 5.5	5.5	500	645	70,691	2028/8/15	
		US TREASURY N/B 6	6.0	1,000	1,245	136,462	2026/2/15	
		US TREASURY N/B 6.125	6.125	1,000	1,316	144,225	2027/11/15	
		US TREASURY N/B 6.25	6.25	800	929	101,794	2023/8/15	
		US TREASURY N/B 6.5	6.5	500	652	71,505	2026/11/15	
		US TREASURY N/B 8	8.0	1,300	1,453	159,274	2021/11/15	
	小	計	—	—	—	81,215,588	—	
(カナダ)	国債証券	CANADA-GOV'T 0.5	0.5	2,000	1,948	162,136	2022/3/1	
		CANADA-GOV'T 0.75	0.75	1,800	1,785	148,540	2020/9/1	
		CANADA-GOV'T 0.75	0.75	2,000	1,976	164,428	2021/3/1	

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

種	類	銘	柄	期			末		
				利	率	額	評 価 額		償 還 年 月 日
							面	金	
				額	額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
		CANADA-GOV' T 0.75		0.75	2,000		1,965	163,556	2021/9/1
		CANADA-GOV' T 1		1.0	3,000		2,946	245,137	2022/9/1
		CANADA-GOV' T 1		1.0	1,600		1,526	126,983	2027/6/1
		CANADA-GOV' T 1.25		1.25	600		576	47,985	2030/6/1
		CANADA-GOV' T 1.5		1.5	2,000		1,989	165,519	2023/6/1
		CANADA-GOV' T 1.5		1.5	1,000		993	82,667	2024/9/1
		CANADA-GOV' T 1.5		1.5	1,000		991	82,501	2026/6/1
		CANADA-GOV' T 1.75		1.75	1,100		1,102	91,743	2023/3/1
		CANADA-GOV' T 2		2.0	900		924	76,885	2028/6/1
		CANADA-GOV' T 2.25		2.25	1,000		1,024	85,201	2024/3/1
		CANADA-GOV' T 2.25		2.25	1,400		1,444	120,173	2025/6/1
		CANADA-GOV' T 2.25		2.25	1,400		1,474	122,676	2029/6/1
		CANADA-GOV' T 2.5		2.5	2,100		2,176	181,118	2024/6/1
		CANADA-GOV' T 2.75		2.75	1,800		1,846	153,593	2022/6/1
		CANADA-GOV' T 2.75		2.75	1,100		1,354	112,661	2048/12/1
		CANADA-GOV' T 2.75		2.75	500		661	55,021	2064/12/1
		CANADA-GOV' T 3.25		3.25	1,000		1,021	85,005	2021/6/1
		CANADA-GOV' T 3.5		3.5	1,500		2,047	170,354	2045/12/1
		CANADA-GOV' T 4		4.0	1,500		2,100	174,759	2041/6/1
		CANADA-GOV' T 5		5.0	1,750		2,605	216,807	2037/6/1
		CANADA-GOV' T 5.75		5.75	250		338	28,153	2029/6/1
		CANADA-GOV' T 5.75		5.75	500		742	61,783	2033/6/1
		CANADA-GOV' T 8		8.0	700		1,008	83,898	2027/6/1
	小	計		-	-		-	3,209,295	-
(メキシコ)	国債証券	MEXICAN BONOS 10		10.0	32,000	千メキシコペソ	36,514	211,052	2024/12/5
		MEXICAN BONOS 5.75		5.75	20,000		19,058	110,157	2026/3/5
		MEXICAN BONOS 6.5		6.5	52,000		51,819	299,514	2022/6/9
		MEXICAN BONOS 7.5		7.5	25,000		26,059	150,625	2027/6/3
		MEXICAN BONOS 7.75		7.75	6,000		6,436	37,201	2031/5/29
		MEXICAN BONOS 7.75		7.75	11,000		11,859	68,545	2034/11/23
		MEXICAN BONOS 8		8.0	27,000		28,240	163,229	2023/12/7
		MEXICAN BONOS 8.5		8.5	28,000		31,311	180,980	2029/5/31
		MEXICAN BONOS 8.5		8.5	40,000		45,877	265,172	2038/11/18
	小	計		-	-		-	1,486,478	-
(ユ - ロ)					千ユーロ	千ユーロ			
(ドイツ)	国債証券	BUNDESUBL-173 0		-	2,500		2,521	307,669	2021/4/9
		BUNDESUBL-174 0		-	3,000		3,035	370,327	2021/10/8
		BUNDESUBL-176 0		-	1,000		1,018	124,226	2022/10/7
		DEUTSCHLAND REP 0		-	3,400		3,507	427,996	2026/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0		-	500		513	62,667	2029/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0.25		0.25	1,800		1,890	230,673	2027/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0.25		0.25	2,900		3,055	372,751	2028/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0.25		0.25	2,400		2,526	308,317	2029/2/15

## 外国債券パッシブ・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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5	2,500	2,636	321,633	2025/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5	1,400	1,487	181,450	2026/2/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5	1,500	1,607	196,093	2027/8/15
		DEUTSCHLAND REP 0.5		0.5	2,000	2,147	262,023	2028/2/15
		DEUTSCHLAND REP 1		1.0	1,300	1,396	170,342	2024/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1		1.0	2,050	2,228	271,946	2025/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1.25		1.25	1,450	1,867	227,910	2048/8/15
		DEUTSCHLAND REP 1.5		1.5	500	534	65,166	2023/2/15
		DEUTSCHLAND REP 1.5		1.5	1,300	1,395	170,228	2023/5/15
		DEUTSCHLAND REP 1.5		1.5	2,000	2,185	266,679	2024/5/15
		DEUTSCHLAND REP 1.75		1.75	2,200	2,334	284,878	2022/7/4
		DEUTSCHLAND REP 1.75		1.75	4,000	4,393	536,048	2024/2/15
		DEUTSCHLAND REP 2		2.0	1,500	1,645	200,772	2023/8/15
		DEUTSCHLAND REP 2.25		2.25	1,400	1,469	179,334	2021/9/4
		DEUTSCHLAND REP 2.5		2.5	500	517	63,104	2021/1/4
		DEUTSCHLAND REP 2.5		2.5	2,200	3,451	421,172	2044/7/4
		DEUTSCHLAND REP 2.5		2.5	2,100	3,367	410,809	2046/8/15
		DEUTSCHLAND REP 3.25		3.25	1,200	2,045	249,611	2042/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4		4.0	1,800	3,042	371,207	2037/1/4
		DEUTSCHLAND REP 4.25		4.25	950	1,734	211,657	2039/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4.75		4.75	1,600	2,309	281,813	2028/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4.75		4.75	4,300	7,380	900,502	2034/7/4
		DEUTSCHLAND REP 4.75		4.75	1,150	2,260	275,787	2040/7/4
		DEUTSCHLAND REP 5.5		5.5	900	1,480	180,665	2031/1/4
		DEUTSCHLAND REP 5.625		5.625	1,000	1,492	182,138	2028/1/4
		DEUTSCHLAND REP 6.25		6.25	1,200	1,536	187,524	2024/1/4
		DEUTSCHLAND REP 6.25		6.25	500	834	101,809	2030/1/4
		DEUTSCHLAND REP 6.5		6.5	1,000	1,531	186,832	2027/7/4
(イタリア)	国債証券	BTPS 0.05		0.05	1,000	1,003	122,417	2021/4/15
		BTPS 0.35		0.35	1,500	1,512	184,515	2021/11/1
		BTPS 0.45		0.45	1,500	1,513	184,678	2021/6/1
		BTPS 0.65		0.65	2,000	2,028	247,511	2023/10/15
		BTPS 0.9		0.9	2,250	2,298	280,471	2022/8/1
		BTPS 0.95		0.95	3,000	3,071	374,741	2023/3/1
		BTPS 0.95		0.95	2,000	2,048	249,922	2023/3/15
		BTPS 1		1.0	2,300	2,355	287,414	2022/7/15
		BTPS 1.2		1.2	1,000	1,027	125,317	2022/4/1
		BTPS 1.25		1.25	1,600	1,643	200,469	2026/12/1
		BTPS 1.35		1.35	2,000	2,060	251,440	2022/4/15
		BTPS 1.45		1.45	2,000	2,074	253,092	2022/9/15
		BTPS 1.45		1.45	1,800	1,880	229,386	2024/11/15
		BTPS 1.45		1.45	1,000	1,041	127,084	2025/5/15
		BTPS 1.5		1.5	2,700	2,818	343,895	2025/6/1
		BTPS 1.6		1.6	1,200	1,261	153,905	2026/6/1

## 外国債券パッシブ・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
			BTPS 1.65	1.65		2,400			2,458	299,980	2032/3/1						
			BTPS 1.85	1.85		1,000			1,061	129,500	2024/5/15						
			BTPS 2	2.0		2,300			2,469	301,310	2025/12/1						
			BTPS 2	2.0		1,600			1,724	210,384	2028/2/1						
			BTPS 2.05	2.05		1,500			1,617	197,319	2027/8/1						
			BTPS 2.1	2.1		1,000			1,079	131,713	2026/7/15						
			BTPS 2.15	2.15		500			522	63,689	2021/12/15						
			BTPS 2.2	2.2		1,000			1,088	132,867	2027/6/1						
			BTPS 2.25	2.25		1,200			1,277	155,896	2036/9/1						
			BTPS 2.3	2.3		600			625	76,375	2021/10/15						
			BTPS 2.45	2.45		1,100			1,213	148,011	2033/9/1						
			BTPS 2.5	2.5		600			656	80,083	2024/12/1						
			BTPS 2.5	2.5		1,100			1,211	147,782	2025/11/15						
			BTPS 2.7	2.7		2,050			2,254	275,057	2047/3/1						
			BTPS 2.8	2.8		300			343	41,867	2028/12/1						
			BTPS 2.8	2.8		900			960	117,244	2067/3/1						
			BTPS 2.95	2.95		1,000			1,150	140,366	2038/9/1						
			BTPS 3	3.0		3,500			4,075	497,265	2029/8/1						
			BTPS 3.1	3.1		1,700			1,979	241,474	2040/3/1						
			BTPS 3.25	3.25		1,500			1,807	220,503	2046/9/1						
			BTPS 3.35	3.35		850			1,029	125,582	2035/3/1						
			BTPS 3.45	3.45		1,600			1,987	242,526	2048/3/1						
			BTPS 3.5	3.5		1,900			2,304	281,187	2030/3/1						
			BTPS 3.75	3.75		2,500			2,621	319,852	2021/3/1						
			BTPS 3.75	3.75		2,000			2,108	257,255	2021/5/1						
			BTPS 3.75	3.75		3,200			3,401	415,001	2021/8/1						
			BTPS 3.75	3.75		2,000			2,298	280,427	2024/9/1						
			BTPS 3.85	3.85		400			528	64,439	2049/9/1						
			BTPS 4	4.0		2,100			2,739	334,263	2037/2/1						
			BTPS 4.5	4.5		2,300			2,627	320,617	2023/5/1						
			BTPS 4.5	4.5		3,000			3,508	428,020	2024/3/1						
			BTPS 4.5	4.5		1,800			2,207	269,306	2026/3/1						
			BTPS 4.75	4.75		2,600			2,815	343,501	2021/9/1						
			BTPS 4.75	4.75		2,500			2,901	354,066	2023/8/1						
			BTPS 4.75	4.75		2,500			3,259	397,630	2028/9/1						
			BTPS 4.75	4.75		1,600			2,359	287,873	2044/9/1						
			BTPS 5	5.0		2,000			2,221	271,013	2022/3/1						
			BTPS 5	5.0		1,000			1,224	149,437	2025/3/1						
			BTPS 5	5.0		2,070			2,946	359,547	2034/8/1						
			BTPS 5	5.0		1,800			2,658	324,320	2039/8/1						
			BTPS 5	5.0		1,700			2,512	306,533	2040/9/1						
			BTPS 5.5	5.5		1,200			1,375	167,865	2022/9/1						
			BTPS 5.5	5.5		2,000			2,307	281,572	2022/11/1						
			BTPS 5.75	5.75		1,700			2,536	309,505	2033/2/1						

## 外国債券パッシブ・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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		BTPS 6		6.0	2,700	4,008	489,113	2031/5/1
		BTPS 6.5		6.5	3,700	5,233	638,553	2027/11/1
		BTPS 7.25		7.25	400	569	69,502	2026/11/1
		BTPS 9		9.0	300	400	48,814	2023/11/1
	(フランス)	国債証券						
		FRANCE O. A. T. 0		—	3,000	3,021	368,712	2021/2/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	4,200	4,237	517,012	2021/5/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,000	2,027	247,375	2022/2/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,200	2,233	272,534	2022/5/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,000	2,038	248,722	2023/3/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	5,000	5,105	622,873	2024/3/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	2,200	2,243	273,688	2025/3/25
		FRANCE O. A. T. 0		—	4,000	3,993	487,278	2029/11/25
		FRANCE O. A. T. 0.25		0.25	2,400	2,481	302,785	2026/11/25
		FRANCE O. A. T. 0.5		0.5	2,900	3,038	370,763	2025/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.5		0.5	3,500	3,676	448,604	2026/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.5		0.5	3,300	3,464	422,668	2029/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.75		0.75	3,300	3,542	432,218	2028/5/25
		FRANCE O. A. T. 0.75		0.75	1,700	1,825	222,682	2028/11/25
		FRANCE O. A. T. 1		1.0	2,050	2,212	269,945	2025/11/25
		FRANCE O. A. T. 1		1.0	2,500	2,723	332,333	2027/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.25		1.25	1,700	1,932	235,843	2034/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.25		1.25	2,400	2,727	332,809	2036/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.5		1.5	3,650	4,229	516,047	2031/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	4,000	4,322	527,405	2023/5/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	2,300	2,549	311,036	2024/11/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	2,900	3,578	436,639	2039/6/25
		FRANCE O. A. T. 1.75		1.75	800	1,038	126,730	2066/5/25
		FRANCE O. A. T. 2		2.0	3,000	3,960	483,163	2048/5/25
		FRANCE O. A. T. 2.25		2.25	1,900	2,056	250,923	2022/10/25
		FRANCE O. A. T. 2.25		2.25	3,400	3,816	465,676	2024/5/25
		FRANCE O. A. T. 2.5		2.5	3,500	4,399	536,829	2030/5/25
		FRANCE O. A. T. 2.75		2.75	4,050	4,992	609,097	2027/10/25
		FRANCE O. A. T. 3		3.0	5,000	5,431	662,666	2022/4/25
		FRANCE O. A. T. 3.25		3.25	2,500	2,681	327,212	2021/10/25
		FRANCE O. A. T. 3.25		3.25	2,200	3,529	430,615	2045/5/25
		FRANCE O. A. T. 3.5		3.5	2,500	3,110	379,457	2026/4/25
		FRANCE O. A. T. 3.75		3.75	3,400	3,602	439,566	2021/4/25
		FRANCE O. A. T. 4		4.0	2,000	3,288	401,195	2038/10/25
		FRANCE O. A. T. 4		4.0	1,170	2,294	279,993	2055/4/25
		FRANCE O. A. T. 4		4.0	1,400	2,873	350,635	2060/4/25
		FRANCE O. A. T. 4.25		4.25	3,000	3,560	434,448	2023/10/25
		FRANCE O. A. T. 4.5		4.5	2,900	5,223	637,277	2041/4/25
		FRANCE O. A. T. 4.75		4.75	2,200	3,670	447,870	2035/4/25
		FRANCE O. A. T. 5.5		5.5	2,750	4,189	511,179	2029/4/25

## 外国債券パッシブ・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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			FRANCE O. A. T. 5. 75	5. 75	2, 800	4, 800	585, 676	2032/10/25
			FRANCE O. A. T. 6	6. 0	3, 000	4, 123	503, 082	2025/10/25
			FRANCE O. A. T. 8. 5	8. 5	600	785	95, 794	2023/ 4 /25
(オランダ)	国債証券		NETHERLANDS GOVT 0	—	1, 800	1, 823	222, 435	2022/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 0	—	2, 000	2, 043	249, 320	2024/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 25	0. 25	1, 700	1, 764	215, 228	2025/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 25	0. 25	300	311	38, 024	2029/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 5	0. 5	1, 500	1, 586	193, 553	2026/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 5	0. 5	600	634	77, 439	2040/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 75	0. 75	1, 400	1, 511	184, 385	2027/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 0. 75	0. 75	1, 200	1, 301	158, 843	2028/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 1. 75	1. 75	1, 600	1, 735	211, 739	2023/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 2	2. 0	1, 000	1, 115	136, 127	2024/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 2. 25	2. 25	1, 500	1, 612	196, 746	2022/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 2. 5	2. 5	1, 000	1, 329	162, 161	2033/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 2. 75	2. 75	1, 200	1, 987	242, 436	2047/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 3. 25	3. 25	800	849	103, 624	2021/ 7 /15
			NETHERLANDS GOVT 3. 75	3. 75	700	795	97, 029	2023/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 3. 75	3. 75	1, 300	2, 308	281, 607	2042/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 4	4. 0	1, 100	1, 827	223, 015	2037/ 1 /15
			NETHERLANDS GOVT 5. 5	5. 5	700	1, 028	125, 521	2028/ 1 /15
(スペイン)	国債証券		SPANISH GOV' T 0. 05	0. 05	1, 100	1, 105	134, 931	2021/ 1 /31
			SPANISH GOV' T 0. 25	0. 25	3, 000	3, 049	372, 069	2024/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 0. 4	0. 4	2, 000	2, 036	248, 461	2022/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 0. 45	0. 45	500	511	62, 375	2022/10/31
			SPANISH GOV' T 0. 75	0. 75	2, 000	2, 038	248, 724	2021/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 1. 3	1. 3	2, 700	2, 916	355, 899	2026/10/31
			SPANISH GOV' T 1. 4	1. 4	2, 000	2, 185	266, 613	2028/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 1. 4	1. 4	1, 600	1, 748	213, 310	2028/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 1. 45	1. 45	600	656	80, 143	2027/10/31
			SPANISH GOV' T 1. 45	1. 45	2, 900	3, 185	388, 610	2029/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 1. 5	1. 5	1, 200	1, 315	160, 510	2027/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 1. 6	1. 6	2, 200	2, 392	291, 898	2025/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 1. 85	1. 85	400	459	56, 119	2035/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 1. 95	1. 95	400	447	54, 610	2026/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 1. 95	1. 95	1, 700	1, 956	238, 766	2030/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 2. 15	2. 15	2, 000	2, 248	274, 341	2025/10/31
			SPANISH GOV' T 2. 35	2. 35	2, 200	2, 674	326, 283	2033/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 2. 7	2. 7	1, 750	2, 342	285, 816	2048/10/31
			SPANISH GOV' T 2. 75	2. 75	2, 100	2, 391	291, 787	2024/10/31
			SPANISH GOV' T 2. 9	2. 9	1, 400	1, 926	235, 084	2046/10/31
			SPANISH GOV' T 3. 45	3. 45	1, 100	1, 759	214, 646	2066/ 7 /30
			SPANISH GOV' T 3. 8	3. 8	1, 900	2, 226	271, 701	2024/ 4 /30
			SPANISH GOV' T 4. 2	4. 2	1, 650	2, 531	308, 924	2037/ 1 /31

## 外国債券パッシブ・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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				4.4	2,000	2,356	287,511	2023/10/31
				4.65	1,800	2,268	276,780	2025/7/30
				4.7	1,800	3,067	374,251	2041/7/30
				4.8	2,000	2,409	293,944	2024/1/31
				4.9	1,500	2,587	315,688	2040/7/30
				5.15	1,500	2,131	260,024	2028/10/31
				5.15	1,200	2,231	272,217	2044/10/31
				5.4	2,250	2,650	323,382	2023/1/31
				5.5	2,700	2,919	356,248	2021/4/30
				5.75	1,500	2,444	298,211	2032/7/30
				5.85	2,200	2,492	304,068	2022/1/31
				5.9	500	690	84,250	2026/7/30
				6.0	2,200	3,317	404,761	2029/1/31
(ベルギー)	国債証券	BELGIAN 0326 4		4.0	700	1,028	125,503	2032/3/28
		BELGIAN 0.8		0.8	1,300	1,382	168,645	2025/6/22
		BELGIAN 0.8		0.8	700	751	91,634	2027/6/22
		BELGIAN 0.8		0.8	500	537	65,619	2028/6/22
		BELGIAN 0291 5.5		5.5	2,000	2,941	358,911	2028/3/28
		BELGIAN 0304 5		5.0	1,600	2,710	330,695	2035/3/28
		BELGIAN 0308 4		4.0	700	774	94,473	2022/3/28
		BELGIAN 0320 4.25		4.25	1,500	2,596	316,782	2041/3/28
		BELGIAN 0321 4.25		4.25	4,300	4,677	570,706	2021/9/28
		BELGIAN 0324 4.5		4.5	1,000	1,302	158,965	2026/3/28
		BELGIAN 0325 4.25		4.25	1,700	1,931	235,673	2022/9/28
		BELGIAN 0328 2.25		2.25	1,500	1,649	201,226	2023/6/22
		BELGIAN 0332 2.6		2.6	500	569	69,448	2024/6/22
		BELGIAN 0333 3		3.0	1,500	2,080	253,821	2034/6/22
		BELGIAN 0338 0.5		0.5	1,000	1,043	127,325	2024/10/22
		BELGIAN 0338 2.25		2.25	500	707	86,380	2057/6/22
		BELGIAN 0344 1.45		1.45	400	465	56,831	2037/6/22
		BELGIAN 1		1.0	1,400	1,515	184,936	2026/6/22
		BELGIAN 1		1.0	1,300	1,430	174,477	2031/6/22
		BELGIAN 1.25		1.25	400	453	55,363	2033/4/22
BELGIAN 1.6		1.6	1,150	1,397	170,528	2047/6/22		
BELGIAN 1.9		1.9	500	623	76,081	2038/6/22		
BELGIAN 2.15		2.15	500	711	86,828	2066/6/22		
BELGIAN 3.75		3.75	800	1,375	167,768	2045/6/22		
(オーストリア)	国債証券	REP OF AUSTRIA 0		—	1,100	1,121	136,778	2023/7/15
		REP OF AUSTRIA 0.5		0.5	1,300	1,368	167,002	2027/4/20
		REP OF AUSTRIA 0.5		0.5	850	894	109,083	2029/2/20
		REP OF AUSTRIA 0.75		0.75	900	963	117,512	2026/10/20
		REP OF AUSTRIA 0.75		0.75	200	214	26,195	2028/2/20
		REP OF AUSTRIA 1.2		1.2	2,000	2,182	266,279	2025/10/20
		REP OF AUSTRIA 1.5		1.5	1,000	1,248	152,297	2047/2/20

## 外国債券パッシブ・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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		REP OF AUSTRIA 1.5	1.5	200	262	32,009	2086/11/2	
		REP OF AUSTRIA 1.65	1.65	1,100	1,211	147,830	2024/10/21	
		REP OF AUSTRIA 1.75	1.75	1,000	1,087	132,744	2023/10/20	
		REP OF AUSTRIA 2.4	2.4	600	787	96,126	2034/5/23	
		REP OF AUSTRIA 3.15	3.15	600	979	119,485	2044/6/20	
		REP OF AUSTRIA 3.4	3.4	1,100	1,229	149,978	2022/11/22	
		REP OF AUSTRIA 3.5	3.5	1,000	1,072	130,809	2021/9/15	
		REP OF AUSTRIA 3.65	3.65	1,000	1,100	134,265	2022/4/20	
		REP OF AUSTRIA 3.8	3.8	500	1,074	131,047	2062/1/26	
		REP OF AUSTRIA 4.15	4.15	1,300	2,149	262,249	2037/3/15	
		REP OF AUSTRIA 4.85	4.85	1,000	1,325	161,758	2026/3/15	
		REP OF AUSTRIA 6.25	6.25	1,000	1,493	182,191	2027/7/15	
(フィンランド)	国債証券	FINNISH GOV'T 0	—	400	405	49,489	2022/4/15	
		FINNISH GOV'T 0.5	0.5	400	421	51,444	2028/9/15	
		FINNISH GOV'T 0.5	0.5	1,400	1,476	180,087	2029/9/15	
		FINNISH GOV'T 0.75	0.75	500	539	65,863	2031/4/15	
		FINNISH GOV'T 1.125	1.125	200	226	27,610	2034/4/15	
		FINNISH GOV'T 1.5	1.5	1,000	1,069	130,437	2023/4/15	
		FINNISH GOV'T 1.625	1.625	1,000	1,061	129,483	2022/9/15	
		FINNISH GOV'T 2	2.0	1,000	1,107	135,184	2024/4/15	
		FINNISH GOV'T 2.625	2.625	500	748	91,314	2042/7/4	
		FINNISH GOV'T 2.75	2.75	600	748	91,345	2028/7/4	
		FINNISH GOV'T 3.5	3.5	1,000	1,055	128,737	2021/4/15	
		FINNISH GOV'T 4	4.0	1,000	1,246	152,113	2025/7/4	
(アイルランド)	国債証券	IRISH GOVT 0	—	400	405	49,477	2022/10/18	
		IRISH GOVT 0.8	0.8	700	720	87,894	2022/3/15	
		IRISH GOVT 0.9	0.9	700	757	92,384	2028/5/15	
		IRISH GOVT 1	1.0	1,000	1,077	131,517	2026/5/15	
		IRISH GOVT 1.1	1.1	1,100	1,212	147,985	2029/5/15	
		IRISH GOVT 1.5	1.5	400	472	57,606	2050/5/15	
		IRISH GOVT 1.7	1.7	300	361	44,056	2037/5/15	
		IRISH GOVT 2	2.0	1,000	1,307	159,519	2045/2/18	
		IRISH GOVT 2.4	2.4	600	744	90,777	2030/5/15	
		IRISH GOVT 3.4	3.4	1,000	1,163	141,902	2024/3/18	
		IRISH GOVT 3.9	3.9	500	571	69,783	2023/3/20	
		IRISH GOVT 5.4	5.4	1,500	1,951	238,159	2025/3/13	
		小 計			—	—	—	63,865,811
(イギリス)	国債証券	UK TSY GILT 0.5	0.5	1,800	1,796	261,306	2022/7/22	
		UK TSY GILT 0.625	0.625	1,000	998	145,185	2025/6/7	
		UK TSY GILT 0.75	0.75	750	753	109,625	2023/7/22	
		UK TSY GILT 0.875	0.875	700	703	102,353	2029/10/22	
		UK TSY GILT 1	1.0	1,000	1,015	147,761	2024/4/22	
		UK TSY GILT 1.25	1.25	1,500	1,563	227,408	2027/7/22	

## 外国債券パッシブ・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
		UK TSY GILT 1.5		1.5		1,000				1,055		153,573					2026/7/22
		UK TSY GILT 1.5		1.5		1,700				1,773		257,949					2047/7/22
		UK TSY GILT 1.625		1.625		2,000				2,152		313,029					2028/10/22
		UK TSY GILT 1.625		1.625		100				110		16,074					2054/10/22
		UK TSY GILT 1.625		1.625		450				531		77,276					2071/10/22
		UK TSY GILT 1.75		1.75		3,000				3,094		450,099					2022/9/7
		UK TSY GILT 1.75		1.75		2,600				2,821		410,437					2037/9/7
		UK TSY GILT 1.75		1.75		1,650				1,823		265,200					2049/1/22
		UK TSY GILT 2		2.0		1,100				1,186		172,579					2025/9/7
		UK TSY GILT 2.25		2.25		2,700				2,863		416,495					2023/9/7
		UK TSY GILT 2.5		2.5		1,600				2,335		339,748					2065/7/22
		UK TSY GILT 2.75		2.75		1,700				1,867		271,673					2024/9/7
		UK TSY GILT 3.25		3.25		1,600				2,239		325,821					2044/1/22
		UK TSY GILT 3.5		3.5		2,550				3,740		544,099					2045/1/22
		UK TSY GILT 3.5		3.5		1,450				2,682		390,131					2068/7/22
		UK TSY GILT 3.75		3.75		1,500				1,581		229,998					2021/9/7
		UK TSY GILT 3.75		3.75		1,600				2,664		387,612					2052/7/22
		UK TSY GILT 4		4.0		1,500				1,613		234,663					2022/3/7
		UK TSY GILT 4		4.0		1,700				3,216		467,820					2060/1/22
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,100				1,405		204,404					2027/12/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,400				1,939		282,089					2032/6/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,050				1,534		223,220					2036/3/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,350				2,064		300,331					2039/9/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,300				2,015		293,149					2040/12/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,500				2,501		363,799					2046/12/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,400				2,423		352,583					2049/12/7
		UK TSY GILT 4.25		4.25		1,700				3,194		464,630					2055/12/7
		UK TSY GILT 4.5		4.5		1,100				1,614		234,815					2034/9/7
		UK TSY GILT 4.5		4.5		1,350				2,213		321,934					2042/12/7
		UK TSY GILT 4.75		4.75		1,450				2,042		297,150					2030/12/7
		UK TSY GILT 4.75		4.75		1,200				1,925		280,110					2038/12/7
		UK TSY GILT 5		5.0		1,600				1,958		284,880					2025/3/7
		UK TSY GILT 6		6.0		950				1,384		201,410					2028/12/7
		UK TSY GILT 8		8.0		1,320				1,462		212,791					2021/6/7
	小	計		—		—				—		11,035,227					—
(スウェーデン)	国債証券	SWEDISH GOVRNMNT 0.75		0.75		4,000			千スウェーデンクローナ	4,271		49,934					2028/5/12
		SWEDISH GOVRNMNT 1		1.0		7,400				7,982		93,316					2026/11/12
		SWEDISH GOVRNMNT 1.5		1.5		7,000				7,488		87,540					2023/11/13
		SWEDISH GOVRNMNT 2.5		2.5		5,000				5,740		67,109					2025/5/12
		SWEDISH GOVRNMNT 3.5		3.5		8,000				8,754		102,337					2022/6/1
		SWEDISH GOVRNMNT 3.5		3.5		4,600				7,191		84,065					2039/3/30
		SWEDISH GOVRNMNT 5		5.0		7,800				8,193		95,786					2020/12/1
	小	計		—		—			千スウェーデンクローナ	—		580,091					—

## 外国債券パッシブ・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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ノルウェー)	国債証券	NORWEGIAN GOV T 1.5	1.5	千ノルウェークロネ 3,500	千ノルウェークロネ 3,533	42,937	2026/2/19	
		NORWEGIAN GOV T 1.75	1.75	5,000	5,110	62,092	2025/3/13	
		NORWEGIAN GOV T 1.75	1.75	2,700	2,766	33,615	2029/9/6	
		NORWEGIAN GOV T 2	2.0	6,000	6,136	74,553	2023/5/24	
		NORWEGIAN GOV T 2	2.0	4,000	4,178	50,767	2028/4/26	
		NORWEGIAN GOV T 3	3.0	4,000	4,280	52,006	2024/3/14	
		NORWEGIAN GOV T 3.75	3.75	6,000	6,207	75,424	2021/5/25	
小 計			—	—	—	391,397	—	
(デンマーク)	国債証券	DENMARK - BULLET 0.25	0.25	千デンマーククロネ 3,500	千デンマーククロネ 3,531	57,675	2020/11/15	
		DENMARK - BULLET 0.5	0.5	8,100	8,673	141,637	2027/11/15	
		DENMARK - BULLET 1.5	1.5	5,000	5,413	88,402	2023/11/15	
		DENMARK - BULLET 1.75	1.75	6,000	6,805	111,128	2025/11/15	
		DENMARK - BULLET 3	3.0	7,000	7,498	122,448	2021/11/15	
		DENMARK - BULLET 4.5	4.5	11,500	11,925	358,049	2039/11/15	
小 計			—	—	—	879,343	—	
(ポーランド)	国債証券	POLAND GOVT BOND 1.75	1.75	千ポーランドズロチ 3,000	千ポーランドズロチ 3,015	86,427	2021/7/25	
		POLAND GOVT BOND 2	2.0	2,000	2,013	57,692	2021/4/25	
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	4,500	4,659	133,535	2026/7/25	
		POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	3,000	3,099	88,817	2027/7/25	
		POLAND GOVT BOND 3.25	3.25	8,900	9,523	272,929	2025/7/25	
		POLAND GOVT BOND 4	4.0	2,700	2,943	84,346	2023/10/25	
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	4,000	4,306	123,409	2021/10/25	
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	2,400	2,670	76,537	2022/9/23	
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	1,400	1,857	53,244	2029/4/25	
小 計			—	—	—	976,939	—	
(オーストラリア)	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	1.5	千オーストラリアドル 1,400	千オーストラリアドル 1,438	108,297	2031/6/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 1.75	1.75	300	302	22,770	2020/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2	2.0	1,000	1,021	76,952	2021/12/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2.25	2,000	2,084	156,992	2022/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2.25	3,000	3,264	245,801	2028/5/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.5	2.5	1,350	1,519	114,392	2030/5/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	2,500	2,707	203,901	2024/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	2,200	2,472	186,152	2027/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	1,800	2,047	154,143	2028/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	1,300	1,487	112,005	2029/11/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2.75	800	943	71,041	2035/6/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3	3.0	1,100	1,394	104,993	2047/3/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	1,900	2,130	160,453	2025/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	2,100	2,480	186,783	2029/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3.25	1,150	1,459	109,915	2039/6/21	

## 外国債券パッシブ・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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		AUSTRALIAN GOVT. 3.75	3.75	1,200	1,615	121,654	2037/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 4.25	4.25	2,150	2,578	194,144	2026/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 4.5	4.5	1,400	1,946	146,533	2033/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 4.75	4.75	2,300	2,905	218,790	2027/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 5.5	5.5	2,000	2,309	173,920	2023/4/21	
		AUSTRALIAN GOVT. 5.75	5.75	2,800	2,993	225,373	2021/5/15	
		AUSTRALIAN GOVT. 5.75	5.75	2,500	2,816	212,091	2022/7/15	
	小	計	—	—	—	3,307,106	—	
(シンガポール)	国債証券	SINGAPORE GOV'T 2.25	2.25	1,100	1,111	89,785	2021/6/1	
		SINGAPORE GOV'T 2.75	2.75	1,200	1,248	100,878	2023/7/1	
		SINGAPORE GOV'T 2.75	2.75	400	454	36,703	2042/4/1	
		SINGAPORE GOV'T 2.75	2.75	700	793	64,124	2046/3/1	
		SINGAPORE GOV'T 2.875	2.875	400	443	35,841	2030/9/1	
		SINGAPORE GOV'T 3	3.0	700	745	60,201	2024/9/1	
		SINGAPORE GOV'T 3.125	3.125	800	833	67,363	2022/9/1	
		SINGAPORE GOV'T 3.375	3.375	950	1,122	90,669	2033/9/1	
		SINGAPORE GOV'T 3.5	3.5	1,800	2,023	163,499	2027/3/1	
	小	計	—	—	—	709,066	—	
(マレーシア)	国債証券	MALAYSIA GOVT 3.418	3.418	7,000	7,059	186,660	2022/8/15	
		MALAYSIA GOVT 3.502	3.502	7,900	7,937	209,866	2027/5/31	
		MALAYSIA GOVT 3.955	3.955	5,300	5,485	145,035	2025/9/15	
		MALAYSIA GOVT 4.498	4.498	5,000	5,382	142,301	2030/4/15	
		MALAYSIA GOVT 4.736	4.736	3,000	3,271	86,494	2046/3/15	
	小	計	—	—	—	770,358	—	
(南アフリカ)	国債証券	REP SOUTH AFRICA 6.5	6.5	60,000	41,310	314,369	2041/2/28	
		REP SOUTH AFRICA 6.75	6.75	16,000	15,986	121,655	2021/3/31	
		REP SOUTH AFRICA 7	7.0	59,000	49,536	376,972	2031/2/28	
		REP SOUTH AFRICA 8	8.0	27,500	25,462	193,767	2030/1/31	
	小	計	—	—	—	1,006,764	—	
	合	計	—	—	—	169,433,468	—	

※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。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### ■ 投資信託財産の構成

(2019年12月17日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 169,433,469	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,747,300	98.4
投 資 信 託 財 産 総 額	172,180,769	1.6
		100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※期末における外貨建資産（171,602,207千円）の投資信託財産総額（172,180,769千円）に対する比率は99.7%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1米ドル=109.56円、1カナダドル=83.20円、1メキシコペソ=5.78円、1ユーロ=122.01円、1英ポンド=145.46円、1スウェーデンクローナ=11.69円、1ノルウェークローネ=12.15円、1デンマーククローネ=16.33円、1ポーランドズロチ=28.66円、1オーストラリアドル=75.30円、1シンガポールドル=80.80円、1マレーシアリンギット=26.44円、1南アフリカランド=7.61円です。

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年12月17日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	173,190,376,657円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,588,753,970
公 社 債(評価額)	169,433,469,191
未 収 入 金	1,009,996,247
未 収 利 息	1,093,891,665
前 払 費 用	64,265,584
(B) 負 債	1,297,746,532
未 払 金	1,009,610,339
未 払 解 約 金	288,134,468
未 払 利 息	1,725
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	171,892,630,125
元 本	94,197,787,250
次 期 繰 越 損 益 金	77,694,842,875
(D) 受 益 権 総 口 数	94,197,787,250口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	18,248円

※当期における期首元本額96,220,120,290円、期中追加設定元本額19,281,670,482円、期中一部解約元本額21,304,003,522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2018年12月18日 至2019年12月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,862,550,604円
受 取 利 息	3,862,909,631
支 払 利 息	△ 359,027
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,383,483,514
売 買 益	9,490,306,434
売 買 損	△ 7,106,822,920
(C) 信 託 報 酬 等	△ 61,607,846
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	6,184,426,272
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	72,674,184,817
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	15,131,895,633
(G) 解 約 差 損 益 金	△16,295,663,847
(H) 計 (D + E + F + G)	77,694,842,875
次 期 繰 越 損 益 金(H)	77,694,842,875

※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。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※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。

※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	21,416,234,918円	SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	105,090,890円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	653,338,604円	世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	558,555円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,771,536,835円	SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	748,096,890円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	890,673,798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>	123,648,852円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	136,965,014円	SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,233,947,890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)	8,807,362円	SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,543,643,762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)	31,937,213円	SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,892,409,294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)	90,257,895円	SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,151,843,262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)	129,206,353円	SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,620,816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)	71,166,457円	SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	10,187,665,851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)	151,244,659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)	413,794,737円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	21,944,188円	SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	171,764,970円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	209,755,424円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	104,353,401円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	228,446,383円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	39,453,718円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	178,930,457円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,885,160円
イオン・バランス戦略ファンド	53,824,408円	SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	130,916,754円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,018,684円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	511,180,891円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,085,507円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	886,798円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	53,273,704円	SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	164,457,715円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	102,132,606円	SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,439,144円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	39,851,024円	SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,536,577円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	18,271,008円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,260,435,983円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	40,500,450円	SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	21,829,928円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	563,635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>	2,731,528,169円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	56,364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>	1,403,654,156円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	56,364円	SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,798,596,392円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	57,463円	SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	610,297,468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>	2,659,394,714円	SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド<適格機関投資家限定>	76,064,013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>	68,956,145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>	49,676,039円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,485,338,822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>	193,332,563円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,453,787,775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>	124,745,649円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,406,346,106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>	862,645,245円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	41,825,379円		

### ■ お知らせ

#### <約款変更について>

- ・委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。(適用日：2019年4月1日)

# SMAM・ マネーインカム ファンド

## <適格機関投資家限定>

【運用報告書(全体版)】

(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

第 **11** 期

決算日 2019年4月15日

### 受益者の皆さまへ

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

### ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／資産複合
信託期間	無期限（設定日：2008年3月31日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 <b>マネーインカム・マザーファンド</b> 円貨建の短期公社債および短期金融商品
当ファンドの運用方法	マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。 <b>■主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。</b>
組入制限	当ファンド <b>■株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</b> <b>■外貨建資産への投資は行いません。</b> <b>マネーインカム・マザーファンド</b> <b>■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</b> <b>■外貨建資産への投資は行いません。</b>
分配方針	年1回（毎年4月13日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、以下の方針に基づき収益分配を行います。 <b>■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。</b> <b>■収益分配金額は、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。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わないことがあります。</b>

 **三井住友DSアセットマネジメント**  
(旧:三井住友アセットマネジメント)  
〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1  
<https://www.smd-am.co.jp>

### ■当運用報告書についてのお問い合わせ

フリーダイヤル 0120-88-2976  
受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

## ■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比	純資産額
	(分配落)	税 分 配	込 金 騰 落 率	期 騰 落 率	期 騰 落 率		
7期 (2015年4月13日)	円 10,090	円 0	% 0.0	100.93	% 0.1	% 96.9	百万円 390
8期 (2016年4月13日)	10,089	0	△0.0	101.01	0.1	64.1	437
9期 (2017年4月13日)	10,080	0	△0.1	100.97	△0.0	76.0	494
10期 (2018年4月13日)	10,073	0	△0.1	100.92	△0.0	75.0	599
11期 (2019年4月15日)	10,066	0	△0.1	100.85	△0.1	72.5	707

※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。

※無担保コール翌日物は、設定時を100として日々の無担保コール翌日物で運用したと仮定した当社計算値です。

## ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
(期首) 2018年4月13日	円 10,073	% -	100.92	% -	% 75.0
4月末	10,072	△0.0	100.91	△0.0	75.4
5月末	10,072	△0.0	100.91	△0.0	70.0
6月末	10,071	△0.0	100.90	△0.0	68.9
7月末	10,071	△0.0	100.90	△0.0	69.4
8月末	10,070	△0.0	100.89	△0.0	74.6
9月末	10,070	△0.0	100.89	△0.0	72.2
10月末	10,069	△0.0	100.88	△0.0	70.7
11月末	10,068	△0.0	100.88	△0.0	73.7
12月末	10,068	△0.0	100.87	△0.0	67.2
2019年1月末	10,067	△0.1	100.86	△0.1	68.9
2月末	10,066	△0.1	100.86	△0.1	60.3
3月末	10,067	△0.1	100.86	△0.1	69.6
(期末) 2019年4月15日	10,066	△0.1	100.85	△0.1	72.5

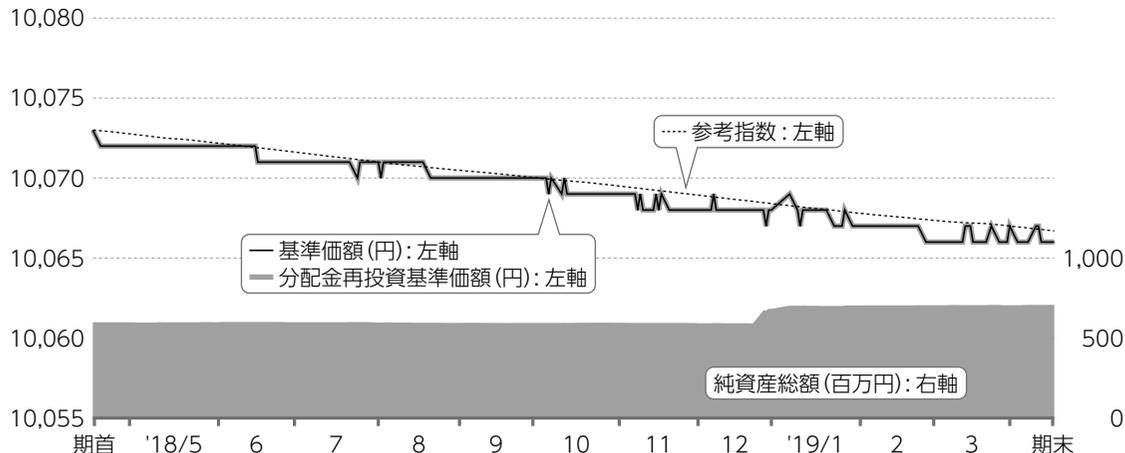
※騰落率は期首比です。

※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。

# 1 運用経過

基準価額等の推移について(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

## 基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額および参考指数は、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	10,073円
期末	10,066円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	-0.1% (分配金再投資ベース)

## 分配金再投資基準価額について

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

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

※当ファンドの参考指数は、無担保コール翌日物です。

※無担保コール翌日物は、設定時を100として日々の無担保コール翌日物で運用したと仮定した当社計算値です。

### 基準価額の主な変動要因(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、円建ての公社債および短期金融商品などへ投資しました。

### 下落要因

- 日銀によるマイナス金利政策が継続され、主要投資対象である短期公社債や短期金融商品におけるマイナス利回りが続いたこと

### 組入れファンドの状況

組入れファンド	投資資産	騰落率	期末組入比率
マネーインカム・マザーファンド	短期金融資産	-0.1%	100.0%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

当期の短期金利は小幅低下し、マイナス圏での推移が継続しました。

物価上昇率が目標とする2%まで乖離がある状態が続いたことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。

日銀は需給動向を勘案しながら短期国債の買入れを調整したことから、国庫短期証券3ヵ月物利回りはマイナス圏でのレンジ推移となりました。国庫短期証券3ヵ月物利回りは期首-0.180%に対し、期末には-0.190%へ小幅低下しました。

ポートフォリオについて(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

---

## 当ファンド

期を通じて「マネーインカム・マザーファンド」を高位に組み入れました。

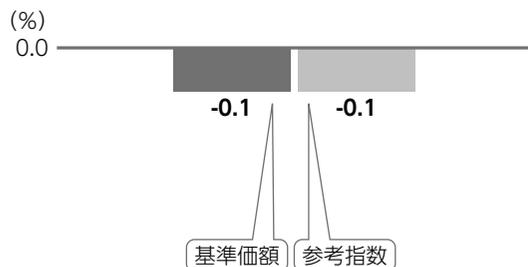
---

## マネーインカム・マザーファンド

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、残存0年から1年3ヵ月の円建て公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを継続しました。また、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮しながら、短期公社債の組入れを行いました。

ベンチマークとの差異について(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

基準価額と参考指数の対比(騰落率)



当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数として無担保コール翌日物を設けています。

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

-1.0

第11期

※基準価額は分配金再投資ベース

分配金について(2018年4月14日から2019年4月15日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第11期
当期分配金	—
(対基準価額比率)	(—%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,211

当期の分配は、基準価額水準等を勘案し、見送りとしたしました。なお、収益分配に充てなかった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、「マネーインカム・マザーファンド」を高位に組み入れて運用を行います。

---

### マネーインカム・マザーファンド

日銀によるマイナス金利政策が継続され、短期国債利回りやコールローン翌日物金利など、主要投資対象である短期公社債および短期金融商品の利回りは引き続きマイナスで推移しています。

残存0年から1年3ヵ月の公社債や短期金融商品で利回りのマイナス幅が小さい投資対象を選定し、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮して運用を行います。

## 3 お知らせ

### 合併について

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友DSアセットマネジメント株式会社に変更しました。

### 約款変更について

- 一般社団法人投資信託協会規則の「信用リスク集中回避のための投資制限」に適合するよう、所要の変更を行いました。

(適用日：2018年4月20日)

- 委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。

(適用日：2019年4月1日)

### 運用担当者に係る事項について(2019年1月1日現在)

#### 運用担当部署の概要

グローバル戦略運用グループ\*、ファンドマネージャー数：28名、平均運用経験年数：14年(兼務者含む)

※2019年4月1日から担当部署がグローバル戦略運用第一部となりました。

## SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

### ■ 1万口当たりの費用明細 (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用 (その他)	2円 (2)	0.015% (0.015)	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	2	0.015	

期中の平均基準価額は10,069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。

※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。

### ■ 当期中の売買及び取引の状況 (2018年4月14日から2019年4月15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
マネーインカム・マザーファンド	千口 130,089	千円 131,430	千口 22,939	千円 23,179

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

利害関係人との取引状況

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

当期中における利害関係人との取引等はありません。

マネーインカム・マザーファンド

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	
公 社 債	百万円 100	% 4.7		百万円 200	百万円 -	% -

※平均保有割合 23.4%

※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。

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、当期中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  
(2018年4月14日から2019年4月15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 (2019年4月15日現在)

親投資信託残高

種 類	期 首 (前期末)		期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
マネーインカム・マザーファンド	千口 592,794	千口 699,943	千円 707,013	千円 707,013

※マネーインカム・マザーファンドの期末の受益権総口数は2,470,784千口です。

※単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

(2019年4月15日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
マネーインカム・マザーファンド	千円 707,013	% 100.0
コール・ローン等、その他	1	0.0
投資信託財産総額	707,014	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年4月15日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	707,014,174円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	970
マ ネ ー イ ン カ ム ・ マ ザ ー フ ァ ン ド ( 評 価 額 )	707,013,204
(B) 純 資 産 総 額 (A)	707,014,174
元 本	702,357,104
次 期 繰 越 損 益 金	4,657,070
(C) 受 益 権 総 口 数	702,357,104口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (B / C)	10,066円

※当期における期首元本額594,837,530円、期中追加設定元本額130,581,256円、期中一部解約元本額23,061,682円です。

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

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

## ■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 ( 税 引 前 )	当	期

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

## ■ 損益の状況

(自2018年4月14日 至2019年4月15日)

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 425,397円
売 益	1,239
買 損	△ 426,636
(B) 当 期 繰 越 損 益 金 (A)	△ 425,397
(C) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 38,607
(D) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,121,074
( 配 当 等 相 当 額 )	( 52,769,661)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△47,648,587)
(E) 計 (B + C + D)	4,657,070
(F) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (E + F)	4,657,070
追 加 信 託 差 損 益 金	5,121,074
( 配 当 等 相 当 額 )	( 52,845,029)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△47,723,955)
分 配 準 備 積 立 金	32,222,120
繰 越 損 益 金	△32,686,124

※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。

※期末における、費用控除後の配当等収益(6,135,934円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(52,845,029円)および分配準備積立金(26,086,186円)より分配可能額は85,067,149円(1万口当たり1,211円)ですが、分配は行っておりません。

# マネーインカム・マザーファンド

第11期（2018年4月14日から2019年4月15日まで）

信託期間	無期限（設定日：2008年3月31日）
運用方針	主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

## ■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比	純総資産額
	騰落率	中率	騰落率	中率		
7期（2015年4月13日）	円 10,122	% 0.1	100.93	% 0.1	% 96.9	百万円 1,498
8期（2016年4月13日）	10,124	0.0	101.01	0.1	64.1	1,306
9期（2017年4月13日）	10,115	△0.1	100.97	△0.0	76.0	1,323
10期（2018年4月13日）	10,108	△0.1	100.92	△0.0	75.0	2,421
11期（2019年4月15日）	10,101	△0.1	100.85	△0.1	72.5	2,495

※無担保コール翌日物は、設定時を100として日々の無担保コール翌日物で運用したと仮定した当社計算値です。

## ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

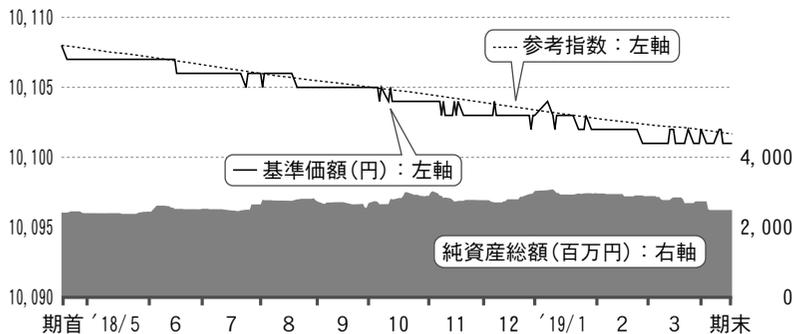
年月日	基準価額		(参考指数) 無担保コール翌日物		債券組入率 比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2018年4月13日	円 10,108	% -	100.92	% -	% 75.0
4月末	10,107	△0.0	100.91	△0.0	75.4
5月末	10,107	△0.0	100.91	△0.0	70.0
6月末	10,106	△0.0	100.90	△0.0	68.9
7月末	10,106	△0.0	100.90	△0.0	69.4
8月末	10,105	△0.0	100.89	△0.0	74.6
9月末	10,105	△0.0	100.89	△0.0	72.2
10月末	10,104	△0.0	100.88	△0.0	70.7
11月末	10,103	△0.0	100.88	△0.0	73.7
12月末	10,103	△0.0	100.87	△0.0	67.2
2019年1月末	10,102	△0.1	100.86	△0.1	68.9
2月末	10,101	△0.1	100.86	△0.1	60.3
3月末	10,102	△0.1	100.86	△0.1	69.6
(期末) 2019年4月15日	10,101	△0.1	100.85	△0.1	72.5

※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（2018年4月14日から2019年4月15日まで）

### 基準価額等の推移



期首	10,108円
期末	10,101円
騰落率	-0.1%

※参考指数は、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。

※当ファンドの参考指数は、無担保コール翌日物です。

※無担保コール翌日物は、設定時を100として日々の無担保コール翌日物で運用したと仮定した当社計算値です。

## ▶ 基準価額の主な変動要因（2018年4月14日から2019年4月15日まで）

当ファンドは、円建ての公社債および短期金融商品などへ投資しました。

### 下落要因

- ・日銀によるマイナス金利政策が継続され、主要投資対象である短期公社債や短期金融商品におけるマイナス利回りが続いたこと

▶ 投資環境について (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

当期の短期金利は小幅低下し、マイナス圏での推移が継続しました。

物価上昇率が目標とする2%まで乖離がある状態が続いたことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。

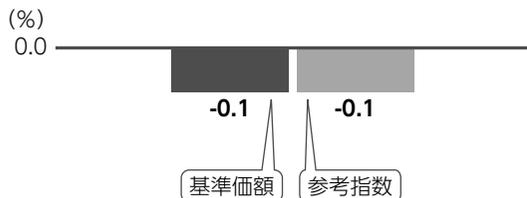
日銀は需給動向を勘案しながら短期国債の買入れを調整したことから、国庫短期証券3ヵ月物利回りはマイナス圏でのレンジ推移となりました。国庫短期証券3ヵ月物利回りは期首-0.180%に対し、期末には-0.190%へ小幅低下しました。

▶ ポートフォリオについて (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、残存0年から1年3ヵ月の円建て公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを継続しました。また、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮しながら、短期公社債の組入れを行いました。

▶ ベンチマークとの差異について (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

基準価額と参考指数の対比 (騰落率)



当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数として無担保コール翌日物を設けています。

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

## 2 今後の運用方針

日銀によるマイナス金利政策が継続され、短期国債利回りやコールローン翌日物金利など、主要投資対象である短期公社債および短期金融商品の利回りは引き続きマイナスで推移しています。

残存0年から1年3ヵ月の公社債や短期金融商品で利回りのマイナス幅が小さい投資対象を選定し、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮して運用を行います。

### ■ 1万口当たりの費用明細 (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用 (その他)	2円 (2)	0.015% (0.015)	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	2	0.015	

期中の平均基準価額は10,104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 (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	特殊債券	2,122,845	200,278 (1,901,000)

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※（ ）内は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。

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2018年4月14日から2019年4月15日まで)

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		
公社債	百万円 2,122	百万円 100	% 4.7	百万円 200	百万円 -	% -

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 (2018年4月14日から2019年4月15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 (2019年4月15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	%	%	%	%	%
特殊債券(除く金融債)	1,796,600 (1,796,600)	1,809,408 (1,809,408)	72.5 (72.5)	— (—)	— (—)	— (—)	72.5 (72.5)
合 計	1,796,600 (1,796,600)	1,809,408 (1,809,408)	72.5 (72.5)	— (—)	— (—)	— (—)	72.5 (72.5)

※( )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。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

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	
特殊債券(除く金融債)	第5回	政府保証阪神高速道路株式会社債券	1.3	64,600	65,404	2020/3/18
	第6回	政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	1.2	100,000	100,835	2019/12/16
	第82回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	131,000	131,408	2019/6/28
	第85回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	100,423	2019/7/31
	第89回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	100,619	2019/9/30
	第91回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	300,000	302,034	2019/10/31
	第93回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	201,000	202,813	2019/11/29
	第95回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	100,873	2019/12/27
	第98回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	101,072	2020/1/31
	第8回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	101,031	2020/1/20
	第10回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	101,226	2020/3/13
	第203回	政府保証預金保険機構債	0.1	100,000	100,109	2020/1/17
	第3回	政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	300,000	301,560	2019/8/16
	合 計			—	1,796,600	1,809,408

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 投資信託財産の構成

(2019年4月15日現在)

項 目	期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
	千円	%	千円	%
公 社 債	1,809,408	72.5	1,809,408	72.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	686,411	27.5	686,411	27.5
投 資 信 託 財 産 総 額	2,495,819	100.0	2,495,819	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年4月15日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	2,495,819,787円
コ ー ル ・ ロ ー ン 債 (評価額)	682,225,729
公 社 債 (評価額)	1,809,408,010
未 収 利 息	3,743,916
前 払 費 用	442,132
(B) 負 債	87,685
未 払 解 約 金	70,000
未 払 利 息	155
そ の 他 未 払 費 用	17,530
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,495,732,102
元 本	2,470,784,621
次 期 繰 越 損 益 金	24,947,481
(D) 受 益 権 総 口 数	2,470,784,621口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,101円

※当期における期首元本額2,395,913,189円、期中追加設定元本額2,164,761,637円、期中一部解約元本額2,089,890,205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。

SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	14,875,223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)	79,155,853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)	56,665,796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)	14,490,786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)	16,880,283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)	8,805,949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)	20,734,392円
米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	699,943,772円
SMAM・バランス先物ファンドVA20<適格機関投資家限定>	492,643,108円
SMAM・FGマネーファンドVA<適格機関投資家限定>	1,066,192,947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>

- ・一般社団法人投資信託協会規則の「信用リスク集中回避のための投資制限」に適合するよう、所要の変更を行いました。

(適用日：2018年4月20日)

- ・委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。

(適用日：2019年4月1日)

## ■ 損益の状況

(自2018年4月14日 至2019年4月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	26,292,005円
受 取 利 息	26,682,079
支 払 買 入 損 益	△ 390,074
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△27,721,660
売 買 損 益	△27,721,660
(C) 信 託 報 酬 等	△ 421,327
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 1,850,982
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	25,804,967
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	22,603,367
(G) 解 約 差 損 益 金	△21,609,871
(H) 計 (D + E + F + G)	24,947,481
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	24,947,481

※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。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※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。

※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。