

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/株式/インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	<p>・日本の取引所に上場されている株式を投資対象とした「日本株式最小分散インデックス・マザーファンド」受益証券に投資することにより、中長期的に日本株式最小分散インデックス(※)に連動した投資成果を目指して運用を行います。</p> <p>・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として信託財産総額の100%とします。</p> <p>(※)東証一部上場銘柄を投資ユニバースとし、委託会社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(所在地：アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市、以下 SSBT という。)が共同開発した『日本株式最小分散モデル』に基づいて構築されたポートフォリオのリターンを委託会社がインデックス化したものであり、SSBT がポートフォリオ構築手法の承認ならびにインデックス算出の情報提供を行います。</p>	
主要運用対象	ベビーファンド	日本株式最小分散インデックス・マザーファンド受益証券
	マザーファンド	わが国の証券取引所に上場されている株式
組入制限	ベビーファンド	・マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。 ・株式への実質投資割合には制限を設けません。
	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は行いません。
分配方針	<p>毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。</p> <p>①分配対象額の範囲 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入および売買益(評価益を含みます)等全額とします。</p> <p>②分配方針 分配金額は、委託者が基準価額水準、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には、分配を行わないこともあります。</p> <p>③留保益の運用方針 収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>	

ステート・ストリート 日本株式最小分散インデックス・オープン

第1期 運用報告書(全体版)
(決算日 2017年2月20日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

この度、「ステート・ストリート日本株式最小分散インデックス・オープン」は、2017年2月20日に第1期の決算を行いましたので、運用状況をご報告させていただきます。

今後とも、ご愛顧のほどよろしくお願い申し上げます。

<ファンドに関する照会先>

営業本部

電話番号 03(4530)7333

お問い合わせ時間(営業日) 9:00~17:00

ホームページアドレス www.ssga.com/jp

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目23番地1号 虎ノ門ヒルズ森タワー25階

◎設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			<ベンチマーク> 日本株式最小分散インデックス		株 式 組入比率	株 式 先物比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
(設 定 日) '16年9月21日	円 10,000	円 -	% -	10,000	% -	% -	% -	百万円 9
1期('17年2月20日)	10,984	10	9.9	11,026	10.3	97.9	0.6	271

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) ベンチマークは、日本株式最小分散インデックスで、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

(注4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

◎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> 日本株式最小分散インデックス		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率		騰 落 率		
(設 定 日) '16年9月21日	円 10,000	% -	10,000	% -	% -	% -
9月末	10,173	1.7	10,179	1.8	98.0	1.5
10月末	10,403	4.0	10,417	4.2	96.5	2.5
11月末	10,596	6.0	10,614	6.1	98.3	1.2
12月末	10,923	9.2	10,946	9.5	97.9	1.6
'17年1月末	10,874	8.7	10,905	9.1	98.0	1.5
(期 末) '17年2月20日	10,994	9.9	11,026	10.3	97.9	0.6

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

(注2) ベンチマークは、日本株式最小分散インデックスで、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

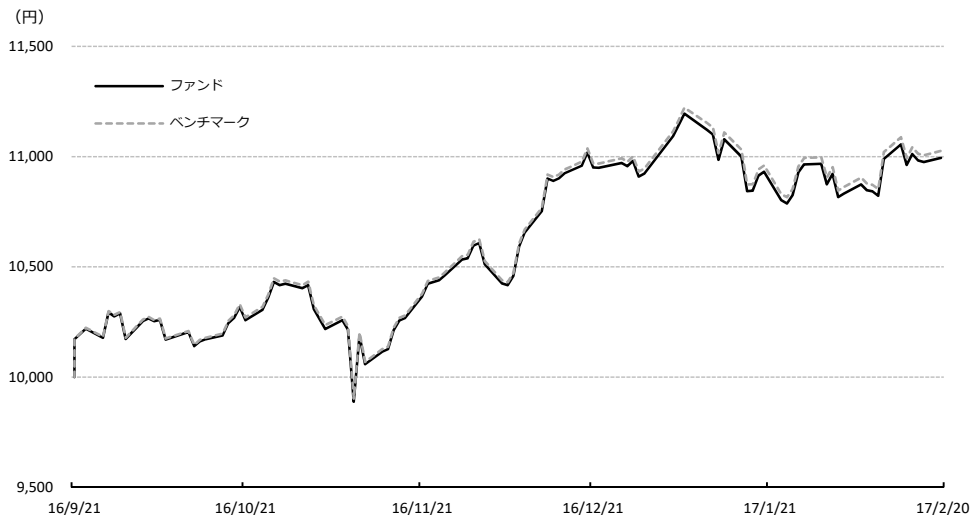
(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

(注4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

当期の運用実績

(2016年9月21日から2017年2月20日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注1) ベンチマークは日本株式最小分散インデックスで、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注2) 期末基準価額は、分配金込みです。

決算期	当初元本	期末基準価額 (分配落ち)	分配金	基準価額 騰落率	ベンチマーク 騰落率
第1期	10,000円	10,984円	10円	+9.9%	+10.3%

当期末の基準価額は 10,984 円となり、分配金 10 円(税込み)を含めると、当初元本の 10,000 円に比べて 994 円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

■ 株式市場の上昇

- 日銀による新たな金融緩和の枠組み導入により金融機関の収益悪化懸念が後退
- 米金融当局による利上げや米国の新政権による財政政策などを背景にした米長期金利上昇と円安ドル高基調

【マイナスの要因】

■ 株式市場の下落

- 米大統領選の結果を受けてのリスク回避の動き
- 米大統領の保護主義的な発言や英国の欧州連合(EU)単一市場からの撤退表明などを受けた先行き不透明感

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+9.9%となり、ベンチマークの騰落率(+10.3%)を0.3%下回りました。主な要因は、以下の通りです。

【マイナスの要因】

- 当ファンドから信託報酬等の費用を控除したこと。

収益分配金

当期の収益分配金は基準価額の水準、市況動向などを勘案した結果、1万口当たり10円(税込み)としております。また収益分配に充てず信託財産に留保した収益は、特に制限を設けず、元本部分と同様の運用を行う方針です。

投資環境

(2016年9月21日から2017年2月20日まで)

国内株式市場

当期の株式市場は、日銀が長短金利を誘導目標とする新たな金融緩和の枠組み導入を決定したことで金融機関の収益悪化懸念が後退し、金融株を中心に上昇して始まりました。その後、10月から11月初旬にかけて決算発表や米大統領選を控えた様子見姿勢から低水準の商いとなりましたが、米大統領選においてトランプ氏優勢の報道が伝わるとリスク回避の動きから円相場が急伸し、国内株式市場は急落しました。しかし、トランプ氏の勝利が確定すると、財政拡大や減税政策への期待から米金利が上昇、円安・ドル高が進んだことを受けて国内株式市場は上昇基調となりました。

2017年1月に入ると、トランプ米大統領の保護主義的な発言やメイ英首相のEU単一市場からの撤退表明などを受けて先行き不透明感が広がり、株式市場は上げ幅を縮小させる展開となりました。期末にかけては、日米首脳会談を無難に終えたことで買い安心感が広がり、さらにイエレン米連邦準備制度理事会(FRB)議長が議会証言で前半の利上げに前向きな姿勢を示したことなどから米株高や円安・ドル高が進み、国内株式市場は堅調に推移しました。

国内株式指数の推移



運用の概況

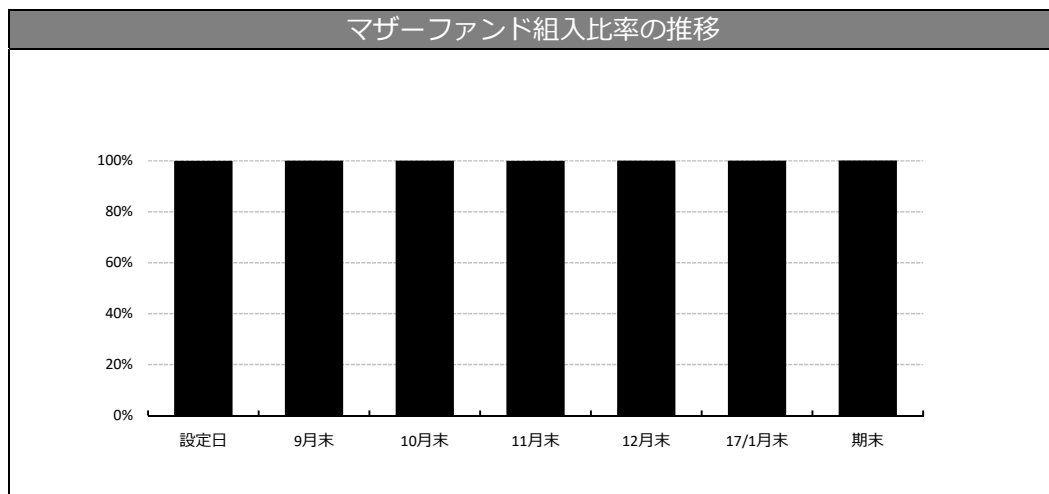
(2016年9月21日から2017年2月20日まで)

当ファンドは「日本株式最小分散インデックス・マザーファンド」(以下、マザーファンドといいます) 受益証券を主な投資対象としています。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。

マザーファンドは、わが国の証券取引所に上場されている株式を主たる投資対象とし、中長期的に日本株式最小分散インデックスに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本的な運用方針としています。株式への投資は原則として高位を維持します。

マザーファンドの組入状況

当期は、設定日からマザーファンドの組み入れを開始し、設定・解約に伴う一時的な増減を除き、マザーファンドを高位に組み入れました。



今後の運用方針

今後も引き続き、マザーファンドを通じて、わが国の証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とし、中長期的な観点から日本株式最小分散インデックスに連動した投資成果を目指して運用を行います。

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当期 (2016年9月21日~2017年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	10,593円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	16円	0.154%	(a) 信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率 消費税は報告日の税率を採用しています。
(投信会社)	(14)	(0.136)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(0)	(0.005)	運用報告書等各種書類の送付、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)	(1)	(0.014)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	3	0.025	(b) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(株式)	(3)	(0.025)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	1	0.005	(c) 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)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託手数料
合 計	20円	0.184%	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(注3) 売買委託手数料は、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。

(注4) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

◎売買および取引の状況('16年9月21日から'17年2月20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
日本株式最小分散 インデックス・マザーファンド	千口 127,558	千円 268,024	千口 4,945	千円 10,807

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎株式売買比率

○株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

日本株式最小分散インデックス・マザーファンド

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	5,214,594 千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	8,074,028 千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.64

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('16年9月21日から'17年2月20日まで)

○株式(日本株式最小分散インデックス・マザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
キーエンス	2	182,484	82,947	ディー・エヌ・エー	62	180,864	2,898
明治ホールディングス	15	145,789	9,850	小野薬品工業	35	89,319	2,581
セコム	13	112,418	8,714	ベネッセホールディングス	23	61,775	2,733
京浜急行電鉄	87	96,420	1,108	カゴメ	21	55,971	2,627
キヤノン	24	79,753	3,323	ファーストリテイリング	2	53,854	33,658
すかいらーく	47	72,386	1,550	日本光電工業	20	53,182	2,632
オリエンタルランド	11	70,534	6,241	住友大阪セメント	120	52,225	435
花王	11	61,697	5,459	西松建設	103	48,906	474
日本たばこ産業	15	59,178	3,971	アコーディア・ゴルフ	36	43,364	1,191
N T T ドコモ	21	53,328	2,601	シマノ	2	37,560	18,780

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。ただし、株数が単位未満の場合は、小数で記載しています。

◎利害関係人との取引状況等('16年9月21日から'17年2月20日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

※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。

◎自社による当ファンドの設定・解約状況

当期設定元本	当期解約元本	当期末残高(元本)	取引の理由
千円	千円	千円	
9,990	9,990	0	当初設定時における取得とその処分

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎組入資産の明細('17年2月20日現在)

○親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
日本株式最小分散インデックス・マザーファンド	千口 122,612	千円 271,783

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末における日本株式最小分散インデックス・マザーファンド全体の口数は4,109,484千口です。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('17年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本株式最小分散インデックス・マザーファンド	千円 271,783	% 99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	354	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	272,137	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

(‘17年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	272,137,187
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	353,542
日本株式最小分散インデックス・マザーファンド(評価額)	271,783,645
(B) 負 債	567,748
未 払 収 益 分 配 金	247,236
未 払 解 約 金	49,175
未 払 信 託 報 酬	263,631
そ の 他 未 払 費 用	7,706
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	271,569,439
元 本	247,236,194
次 期 繰 越 損 益 金	24,333,245
(D) 受 益 権 総 口 数	247,236,194口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D × 10,000)	10,984円

(注) 設定元本額	9,990,000円
期中追加設定元本額	247,324,330円
期中一部解約元本額	10,078,136円

◎損益の状況

当期(自‘16年9月21日 至‘17年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 3
支 払 利 息	△ 3
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	14,127,606
売 買 益	14,566,658
売 買 損	△ 439,052
(C) 信 託 報 酬 等	△ 271,337
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	13,856,266
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,724,215
(売 買 損 益 相 当 額)	(10,724,215)
(F) 計 (D + E)	24,580,481
(G) 収 益 分 配 金	△ 247,236
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	24,333,245
追 加 信 託 差 損 益 金	10,724,215
(配 当 等 相 当 額)	(140,302)
(売 買 損 益 相 当 額)	(10,583,913)
分 配 準 備 積 立 金	13,609,030

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。
(注3) (E)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。

◎1万口当たり分配原資の内訳(税込み)

項 目	第 1 期 (2016年9月21日～ 2017年2月20日)
当期分配金	10円
(対基準価額比率)	0.091%
当期の収益	10円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	984円

- (注1) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
(注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎当期の分配金のお知らせ

1万口当たり分配金	10円
-----------	-----

(注) 分配金の計算過程

計算期間末における費用控除後の配当等収益(660,478円)、費用控除後の有価証券等損益額(13,195,788円)、および信託約款に規定する収益調整金(10,724,215円)より分配対象収益は24,580,481円(10,000口当たり994円)であり、うち247,236円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

◎約款変更のお知らせ

- ・運用報告書(全体版)について電磁的交付方法により提供するための所要の変更を2016年11月15日に行いました。

日本株式最小分散インデックス・マザーファンド

第8期 運用報告書 (決算日 2017年2月20日)

日本株式最小分散インデックス・マザーファンドの
第8期の運用状況をご報告させていただきます。

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	<ul style="list-style-type: none"> ・中長期的な観点から「日本株式最小分散インデックス(※)」に連動した投資成果を目指して運用を行います。 ・株式の組入比率は、原則として信託財産総額の100%を基本とします。 <p>(※)東証一部上場銘柄を投資ユニバースとし、委託者とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(所在地:アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市、以下「SSBT」という。)が共同開発した『日本株式最小分散モデル』に基づいて構築されたポートフォリオのリターンを委託者がインデックス化したものであり、SSBTがポートフォリオ構築手法の承認ならびにインデックス算出の情報提供を行います。(以下、同じ。)</p>
主 要 運 用 対 象	わが国の証券取引所に上場されている株式
組 入 制 限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式の投資割合には制限を設けません。 ・原則として、外貨建資産への投資は行いません。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目23番地1号 虎ノ門ヒルズ森タワー25階

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額		<ベンチマーク> 日本株式最小分散インデックス		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率			
4期('13年2月20日)	11,370	21.4	11,441	22.0	98.2	1.0	1,533
5期('14年2月20日)	14,376	26.4	14,570	27.3	97.5	1.1	2,232
6期('15年2月20日)	19,174	33.4	19,474	33.7	97.2	1.6	7,431
7期('16年2月22日)	19,898	3.8	20,278	4.1	98.5	0.9	11,860
8期('17年2月20日)	22,166	11.4	22,590	11.4	97.8	0.6	9,109

(注1) ベンチマークは、日本株式最小分散インデックスで、ファンド設定日の前営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注2) 先物比率=買建比率-売建比率

◎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> 日本株式最小分散インデックス		株式 組入比率	株式 先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) '16年2月22日	19,898	-	20,278	-	98.5	0.9
2月末	19,767	△ 0.7	20,145	△ 0.7	98.8	0.9
3月末	20,734	4.2	21,138	4.2	97.6	1.8
4月末	20,582	3.4	20,985	3.5	98.1	1.5
5月末	21,000	5.5	21,399	5.5	98.1	1.4
6月末	20,100	1.0	20,490	1.0	98.2	1.3
7月末	20,701	4.0	21,098	4.0	98.5	1.1
8月末	19,673	△ 1.1	20,046	△ 1.1	98.5	1.1
9月末	20,456	2.8	20,854	2.8	98.0	1.5
10月末	20,943	5.3	21,342	5.2	96.5	2.5
11月末	21,343	7.3	21,746	7.2	98.3	1.2
12月末	22,010	10.6	22,426	10.6	97.9	1.6
'17年1月末	21,919	10.2	22,343	10.2	98.0	1.5
(期末) '17年2月20日	22,166	11.4	22,590	11.4	97.8	0.6

(注1) 騰落率は期首比です。

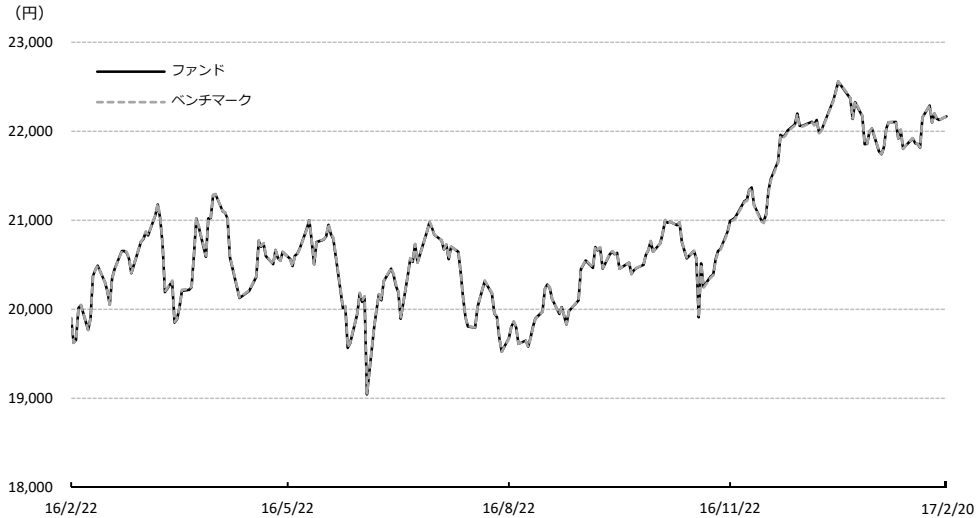
(注2) ベンチマークは、日本株式最小分散インデックスで、ファンド設定日の前営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

当期の運用実績

(2016年2月23日から2017年2月20日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークは日本株式最小分散インデックスで、前期末の基準価額にあわせて指数化しています。

当期末の基準価額は22,166円となり、前期末の19,898円に比べて2,268円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

- 株式市場の上昇
 - 日銀による追加金融緩和や政府の大型経済対策への期待
 - 米金融当局による利上げや米国の新政権による財政政策などを背景にした米長期金利上昇と円安ドル高基調

【マイナスの要因】

- 株式市場の下落
 - 米長期金利の低下を受けての円高ドル安傾向
 - 英国の欧州連合(EU)離脱を問う国民投票や米大統領選の結果を受けてのリスク回避の動き

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+11.4%となり、ベンチマークの騰落率(+11.4%)と同水準となりました。当期の運用実績はベンチマークに連動した結果となりました。

投資環境

(2016年2月23日から2017年2月20日まで)

国内株式市場

当期の株式市場は、円高進行で企業業績への不透明感が強まる市場環境の中、米株や原油価格、円相場の動向に振られる展開で始まりました。4月に入ると、米長期金利の低下を受けて円高・ドル安傾向となったことや、日銀が追加緩和を見送ったことで急落する局面がありました。その後も、米雇用統計が予想を下回ったことを背景に米早期利上げ観測が後退し円高が進行したことで軟調な展開が続きました。加えて英国のEU離脱を問う国民投票で離脱が確実との結果を受けリスク回避姿勢が強まると株式市場は6月下旬に急落しました。7月に入ると、米雇用統計の改善を受けて米利上げ観測が強まり円安・ドル高となったことや、日銀による追加金融緩和や政府の大型経済対策への期待から株式市場は上昇基調に転じました。9月は日銀が長短金利を誘導目標とする新たな金融緩和の枠組み導入を決定すると、金融株を中心に一時的に上昇しました。その後、10月から11月初旬にかけて決算発表や米大統領選を控えた様子見姿勢から低水準の商いとなりましたが、米大統領選においてトランプ氏優勢の報道が伝わりリスク回避の動きから円相場が急伸し、国内株式市場は急落しました。しかし、トランプ氏の勝利が確定すると、財政拡大や減税政策への期待から米金利が上昇、円安・ドル高が進んだことを受けて国内株式市場は上昇基調となりました。2017年1月に入ると、トランプ米大統領の保護主義的な発言やメイ英首相のEU単一市場からの撤退表明などを受けて先行き不透明感が広がり、株式市場は上げ幅を縮小させる展開となりました。期末にかけては、日米首脳会談を無難に終えたことで買い安心感が広がり、さらに、イエレン米連邦準備制度理事会(FRB)議長が議会証言で年前半の利上げに前向きな姿勢を示したことなどから米株高や円安・ドル高が進み、国内株式市場は堅調に推移しました。

国内株式指数の推移



運用の概況

(2016年2月23日から2017年2月20日まで)

当マザーファンドは、当期中、わが国の証券取引所に上場されている株式を主たる投資対象とし、運用ベンチマークである「日本株式最小分散インデックス」への連動を目指し、現物株式ポートフォリオを構築しました。株式の組入比率は原則として高位を維持しています。

四半期毎に実施されるベンチマークの見直しに際しては、適宜ポートフォリオの見直しを行いました。日次でキャッシュ比率のモニターを行い、未収配当金の積み上がりなどによるキャッシュ比率の増加には先物を買って建てることにより対応しました。また、少なくとも月に一度ポートフォリオを見直すとともに、必要に応じて現物株式取引を実施しました。

今後の運用方針

今後も引き続き、わが国の証券取引所に上場されている株式等を主要投資対象とし、中長期的な観点から、「日本株式最小分散インデックス」に連動した投資成果を目指して運用を行います。

◎1万口(元本 10,000 円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2016年2月23日~2017年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	20,769円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	8円 (8) (0)	0.038% (0.037) (0.001)	(a) 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 売買委託手数料は、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)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、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 (そ の 他)	0 (0)	0.001 (0.001)	(c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 その他は、金銭信託手数料
合 計	8円	0.039%	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

◎売買および取引の状況('16年2月23日から'17年2月20日まで)

○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
		2,841 (Δ97)	4,281,940 (-)	6,179	7,835,303

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、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。

(注3) 単位未満は切り捨てています。ただし、株数が単位未満の場合は、小数で記載しています。

○先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株 式 先 物 取 引	百万円	百万円	百万円	百万円
		941	1,012	-	-

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎株式売買比率

○株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	12,117,244 千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	8,559,149 千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.41

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('16年2月23日から'17年2月20日まで)

○株 式

銘 柄	買 付			銘 柄	売 付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
キーエンス	2	182,484	82,947	ディー・エヌ・エー	93	246,379	2,635
明治ホールディングス	14	145,789	9,850	小野薬品工業	52	218,019	4,121
中国電力	86	114,077	1,312	太平洋セメント	730	185,881	254
セコム	12	112,418	8,714	ニトリホールディングス	15	177,814	11,325
オリエンタルランド	16	108,635	6,664	N T T ドコモ	57	148,504	2,605
日本製紙	55	108,383	1,963	日本電信電話	28	134,484	4,785
京浜急行電鉄	89	98,324	1,104	ベネッセホールディングス	46	133,757	2,901
すかいらーく	63	94,569	1,482	K D D I	43	132,344	3,049
キヤノン	25	82,999	3,306	住友大阪セメント	273	122,522	448
ベネッセホールディングス	29	81,125	2,740	西松建設	251	119,660	476

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。ただし、株数が単位未満の場合は、小数で記載しています。

◎利害関係人との取引状況等('16年2月23日から'17年2月20日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

※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。

◎組入資産の明細('17年2月20日現在)

(1)国内株式

上場株式

銘柄	期首 (前期末)		当期末		銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	
	千株	千株	千株	千円		千株	千株	千株	千円
水産・農林業(1.2%)					東洋精糖	—	3	357	
極洋	43	1	3,706		日本甜菜製糖	29	1	2,953	
マルハニチロ	34	22	73,912		三井製糖	20	2	7,176	
サカタのタネ	6	4	15,288		塩水港精糖	—	3	947	
ホクト	8	5	11,320		日新製糖	—	1	2,570	
鉱業(-%)					中村屋	6	0.3	1,539	
日本海洋掘削	2	—	—		名糖産業	1	1	1,944	
建設業(7.9%)					不二家	94	24	5,352	
ショーボンドホールディングス	9	6	31,500		第一屋製パン	—	6	756	
タマホーム	—	2	1,609		モロゾフ	4	2	1,016	
サンヨーホームズ	4	0.7	464		寿スピリッツ	1	—	—	
コムシスホールディングス	36	25	52,245		ヤクルト本社	4	3	18,810	
ヤマウラ	—	4	2,736		明治ホールディングス	—	13	112,710	
大成建設	297	198	159,588		雪印メグミルク	14	—	—	
飛鳥建設	144	—	—		日本ハム	—	1	3,065	
西松建設	289	133	77,805		伊藤ハム	73	—	—	
三井住友建設	378	264	32,545		丸大食品	38	11	5,467	
東鉄工業	3	2	7,233		米久	3	—	—	
熊谷組	163	114	36,366		S Foods	6	4	13,284	
三井ホーム	5	2	1,152		伊藤ハム米久ホールディングス	—	46	50,761	
大東建託	5	3	56,790		キリンホールディングス	34	24	45,804	
前田道路	20	14	28,168		オエノンホールディングス	43	10	2,650	
東洋建設	48	30	13,101		養命酒製造	1	0.4	748	
積水ハウス	22	—	—		サントリー食品インターナショナル	47	33	153,915	
西部電気工業	2	0.3	688		ダイドーグループホールディングス	3	2	16,356	
四電工	2	1	425		伊藤園	17	12	45,942	
きんでん	32	23	34,155		キーコーヒー	5	3	7,689	
協和エクシオ	37	41	66,227		ユニカフェ	1	0.9	878	
NDS	5	0.6	1,752		ジャパンフーズ	0.7	0.5	691	
日揮	19	13	27,510		日清オイリオグループ	—	21	12,180	
大気社	10	7	20,526		不二製油グループ本社	7	5	12,578	
ダイダン	3	2	1,922		かどや製油	0.3	0.1	468	
東芝プラントシステム	—	29	46,880		J-オイルミルズ	20	1	5,740	
新興プランテック	7	5	4,748		味の素	88	61	143,113	
食料品(14.4%)					キューピー	30	21	63,253	
日東富士製粉	3	0.1	399		ハウス食品グループ本社	38	19	47,122	
鳥越製粉	5	1	970		カゴメ	42	27	80,296	
フィード・ワン	—	23	4,248		焼津水産化学工業	2	0.6	737	

銘柄	期首 (前期末)	当期末		銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
アリアケジャパン	5	3	21,840	エステー	2	1	2,771
ピエトロ	-	0.4	662	アグロ カネシヨウ	2	1	1,441
エバラ食品工業	0.9	0.3	629	小林製薬	8	11	60,436
ニチレイ	-	15	38,988	日本高純度化学	1	0.8	1,984
イトアインド	1	0.6	1,372	新田ゼラチン	-	1	906
日清食品ホールディングス	34	24	148,588	アース製薬	9	6	33,726
永谷園ホールディングス	3	3	4,275	大成ラミック	1	0.4	1,258
一正蒲鉾	-	0.9	1,063	レック	0.8	-	-
フジッコ	5	4	9,800	前澤化成工業	-	1	1,329
ロック・フィールド	3	4	7,098	エフピコ	1	1	7,210
日本たばこ産業	48	40	151,714	ユニ・チャーム	12	-	-
ケンコーマヨネーズ	2	1	3,794	医薬品(5.1%)			
わらべや日洋ホールディングス	6	3	9,956	武田薬品工業	40	28	146,776
なとり	1	1	2,238	アステラス製薬	46	32	49,626
理研ビタミン	1	0.7	3,038	田辺三菱製薬	11	7	17,901
繊維製品(0.5%)				ロート製薬	9	6	14,041
シキボウ	61	33	5,049	小野薬品工業	11	0.4	1,009
トーア紡コーポレーション	-	1	651	久光製薬	6	4	26,359
ダイドーリミテッド	3	2	1,132	持田製薬	1	1	10,959
東レ	31	21	20,422	参天製薬	38	27	43,821
日本フェルト	1	1	524	ツムラ	34	24	82,716
イチカワ	-	2	602	キッセイ薬品工業	12	9	25,776
アツギ	105	24	3,048	日水製薬	2	1	2,323
クラウドディア	1	0.7	384	東和薬品	2	-	-
オンワードホールディングス	16	11	9,438	富士製薬工業	0.8	0.6	1,851
ヤマトインターナショナル	3	2	826	キョーリン製薬ホールディングス	6	4	11,087
バルブ・紙(0.9%)				大塚ホールディングス	5	3	19,073
日本製紙	-	40	79,834	石油・石炭製品(2.3%)			
化学(5.1%)				昭和シェル石油	35	24	26,558
多木化学	3	1	944	東燃ゼネラル石油	189	132	173,844
信越化学工業	2	2	19,730	ビーピー・カストロール	5	1	2,641
エア・ウォーター	39	27	59,238	ゴム製品(0.8%)			
アイカ工業	12	8	24,343	ブリヂストン	21	15	69,599
日油	4	2	2,528	ガラス・土石製品(1.3%)			
花王	33	28	162,646	日本山村硝子	-	11	2,244
ライオン	30	6	11,244	オハラ	1	3	3,732
コタ	0.6	0.6	796	住友大阪セメント	370	204	94,044
シーズ・ホールディングス	29	12	37,380	太平洋セメント	717	-	-
シーボン	0.6	0.3	766	デイ・シイ	2	-	-
ノエビアホールディングス	2	4	18,832	アジアパイルホールディングス	11	-	-
アジュバンコスメジャパン	2	1	1,168	品川リフラクトリーズ	13	-	-

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヨータイ	4	2	772
東京窯業	—	3	627
ニチアス	19	14	15,386
鉄鋼(0.7%)			
丸一鋼管	23	16	59,677
非鉄金属(0.1%)			
カナレ電気	0.7	0.9	2,032
アサヒホールディングス	5	3	7,722
金属製品(0.5%)			
稲葉製作所	2	1	1,996
アルインコ	1	2	2,730
LIXILグループ	1	1	2,770
リンナイ	5	3	30,555
ダイニチ工業	0.8	0.8	585
三洋工業	—	3	594
岡部	4	3	3,286
中国工業	1	0.6	418
モリテック スチール	—	1	510
機械(1.3%)			
日本ドライケミカル	0.7	0.4	924
三井海洋開発	7	5	13,664
オイレス工業	10	4	9,677
巴工業	1	0.8	1,501
荏原実業	1	0.5	685
オルガノ	2	—	—
平和	30	21	62,558
理想科学工業	6	—	—
SANKYO	4	3	13,481
マースエンジニアリング	—	1	2,526
マックス	4	3	4,581
セガサミーホールディングス	7	5	9,732
前澤給装工業	—	0.5	764
電気機器(6.9%)			
日本電産	5	2	27,794
ヤーマン	2	1	9,856
不二電機工業	0.4	0.3	412
ナカヨ	7	2	840
アンリツ	28	19	16,617
日立マクセル	21	6	14,156
アズビル	14	10	37,327
日本光電工業	25	—	—

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
チノー	—	0.4	487
小野測器	2	0.9	789
キーエンス	—	4	194,700
日置電機	1	0.9	2,005
メガチップス	9	—	—
岡谷電機産業	3	1	504
キャノン電子	8	2	4,822
キャノン	55	53	175,961
リコー	187	131	131,462
輸送用機器(0.3%)			
日産自動車	28	—	—
トヨタ自動車	5	—	—
レシップホールディングス	2	1	1,281
ダイハツ工業	29	—	—
本田技研工業	5	3	12,866
シマノ	3	1	16,570
精密機器(0.0%)			
クリエートメディック	2	0.5	475
JMS	4	2	650
愛知時計電機	—	0.2	745
リズム時計工業	27	8	1,496
松風	1	0.8	1,095
その他製品(1.1%)			
スノーピーク	—	2	6,534
パラマウントベッドホールディングス	3	2	9,141
SHO-BI	2	1	834
永大産業	—	3	1,599
ダンロップスポーツ	3	1	1,454
バンダイナムコホールディングス	18	12	39,808
共立印刷	9	4	1,449
As-me エステール	0.8	0.8	553
光村印刷	4	2	534
宝印刷	4	2	3,473
小松ウオール工業	—	0.6	1,165
ピジョン	20	—	—
キングジム	3	7	6,256
コクヨ	22	15	24,289
グローブライド	—	2	3,602
アデランス	21	—	—
電気・ガス業(4.1%)			
中国電力	—	70	86,221

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
北陸電力	—	45	50,488
東北電力	—	43	62,064
沖縄電力	0.6	11	30,845
電源開発	32	23	61,870
大阪瓦斯	154	108	46,602
東邦瓦斯	43	30	23,820
北海道瓦斯	16	5	1,390
陸運業(5.8%)			
相鉄ホールディングス	69	48	27,264
京浜急行電鉄	63	111	135,531
小田急電鉄	11	3	8,258
京王電鉄	43	30	26,490
富士急行	—	8	8,088
新京成電鉄	7	3	1,260
東日本旅客鉄道	1	1	11,302
西日本旅客鉄道	18	12	93,345
東海旅客鉄道	1	1	20,482
西日本鉄道	40	28	13,692
阪急阪神ホールディングス	68	9	35,720
南海電気鉄道	150	105	57,960
京阪ホールディングス	46	32	22,944
神戸電鉄	9	10	3,810
名古屋鉄道	106	74	38,628
山陽電気鉄道	9	10	6,070
丸運	—	1	459
丸全昭和運輸	—	4	1,796
日本石油輸送	—	0.2	502
神奈川中央交通	3	4	2,888
C&F ロジホールディングス	1	—	—
空運業(0.8%)			
日本航空	26	18	68,076
倉庫・運輸関連業(0.1%)			
滋澤倉庫	9	6	2,106
東陽倉庫	4	2	596
中央倉庫	0.7	0.4	438
安田倉庫	2	—	—
キムラユニティー	1	0.9	1,081
エーアイティー	—	1	1,095
情報・通信業(12.3%)			
NEC ネットエスアイ	7	5	11,894
システナ	8	6	10,269

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キューブシステム	1	9	6,566
ソフトクリエイトホールディングス	2	—	—
電算システム	3	0.9	1,534
グリー	72	50	34,306
電算	0.6	0.2	486
AGS	0.8	0.6	1,149
ザッパラス	5	2	1,005
GMO クラウド	2	—	—
朝日ネット	5	2	1,260
AOI TYO Holdings	—	3	3,115
フェイス	1	0.4	539
ハイマックス	0.5	0.3	447
野村総合研究所	7	5	20,254
ティー・ワイ・オー	69	—	—
オービック	10	7	37,985
ヤフー	495	346	182,447
トレンドマイクロ	17	12	60,500
インフォメーション・ディベロップメント	1	1	1,169
日本オラクル	13	9	62,040
CAC Holdings	5	2	3,038
トーセ	5	2	1,823
アイティフォー	6	—	—
東計電算	1	0.6	1,329
エックスネット	0.6	0.3	618
大塚商会	11	8	48,887
ソフトブレイン	4	—	—
ウェザーニューズ	5	—	—
CIJ	3	1	957
東洋ビジネスエンジニアリング	0.4	0.5	773
日本コロムビア	6	—	—
ネットワンシステムズ	61	36	32,582
アルゴグラフィックス	1	0.8	1,970
兼松エレクトロニクス	0.6	0.5	1,288
日本テレビホールディングス	7	5	11,312
日本BS放送	—	1	1,783
クロップス	1	0.7	421
日本電信電話	53	35	170,801
KDDI	82	52	155,287
NTT ドコモ	100	65	175,453
アイネット	2	1	1,350
松竹	32	22	29,018

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エヌ・ティ・ティ・データ	6	4	22,512
ピー・シー・エー	0.8	0.4	624
ジャステック	3	-	-
JBCC ホールディングス	2	1	967
ソフトバンクグループ	18	-	-
卸売業(3.7%)			
高千穂交易	1	0.5	527
伊藤忠食品	0.6	0.4	1,806
トーメンデバイス	0.5	0.3	648
東京エレクトロン デバイス	2	1	1,599
アルフレッサ ホールディングス	11	-	-
横浜冷凍	15	19	20,572
山下医科器械	-	0.2	359
パイカケ・エスケ・ホールディングス	4	6	6,996
TOKAI ホールディングス	-	40	33,687
ミタチ産業	-	0.8	516
デリカフーズ	1	1	1,273
コメダホールディングス	-	26	51,205
富士興産	1	-	-
エコートレーディング	0.8	0.8	563
中山福	2	1	1,026
メディバルホールディングス	12	8	15,623
SPK	1	0.3	758
尾家産業	0.4	0.4	465
シモジマ	0.8	0.6	719
小津産業	0.4	0.6	1,303
高速	1	0.9	1,003
たけびし	-	0.6	846
橋本総業ホールディングス	0.4	0.3	450
白銅	-	0.7	1,250
蝶理	2	0.7	1,398
東都水産	6	0.2	392
OUG ホールディングス	4	2	526
スターゼン	1	1	6,350
キャノンマーケティングジャパン	9	6	15,276
フルサト工業	1	0.7	1,215
東邦ホールディングス	4	3	8,676
サンゲツ	10	7	14,274
シナネンホールディングス	6	0.7	1,608
伊藤忠エネクス	20	9	9,156
トーヨー	1	0.6	1,521

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
モスフードサービス	11	7	25,308
オートバックスセブン	26	27	49,194
イノテック	4	3	2,088
イエローハット	-	3	10,877
因幡電機産業	5	3	12,400
タキヒヨー	4	2	966
蔵王産業	1	0.4	602
スズケン	7	5	20,325
小売業(14.4%)			
ローソン	8	7	58,473
ダイユーエイト	3	-	-
エービーシー・マート	32	21	140,910
ゲオホールディングス	24	16	22,932
アダストリア	2	-	-
ジーフット	-	2	1,883
キャンドウ	5	2	3,628
ワッツ	-	1	1,426
あみやき亭	1	0.8	3,256
ひらまつ	10	6	3,960
サッポロドラッグストアー	0.5	-	-
大黒天物産	0.2	0.1	503
ハニーズ	7	4	5,453
アルペン	10	7	13,944
ダイヤモンドダイニング	-	0.7	1,173
きちり	3	1	924
ドトール・日レスホールディングス	15	8	18,807
物語コーポレーション	4	2	9,366
丸善CHIホールディングス	-	2	982
鳥貴族	-	3	8,009
ホットランド	-	2	2,889
すかいらく	-	58	94,315
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	16	11	11,110
ブックオフコーポレーション	3	2	2,142
コスモス薬品	1	1	27,573
一六堂	4	1	609
セブン&アイ・ホールディングス	34	24	106,064
フェリシモ	-	0.5	517
トリドールホールディングス	7	5	13,013
ダイユー・リックホールディングス	-	1	872
はるやまホールディングス	0.8	1	1,276
カッパ・クリエイト	14	6	8,825

銘柄	期首 (前期末)	当期末		銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
三城ホールディングス	4	1	904	ブレナス	6	8	20,958
ハウス オブ ローゼ	0.7	0.4	620	ミニストップ	—	7	17,111
イオン北海道	10	1	1,110	藤久	1	0.3	523
ヒマラヤ	1	0.8	685	大庄	2	1	2,233
マルシエ	1	1	1,260	ファーストリテイリング	4	1	41,988
西松屋チェーン	—	21	27,560	ヤマザワ	0.6	0.3	557
ゼンショーホールディングス	50	35	67,237	銀行業(0.0%)			
幸楽苑ホールディングス	3	1	3,018	島根銀行	0.7	0.5	705
ハークスレイ	—	0.8	895	みちのく銀行	20	4	764
サイゼリヤ	10	7	18,480	不動産業(0.8%)			
ポプラ	1	0.7	364	パーク24	11	7	24,141
ユナイテッドアローズ	5	—	—	東京樂天地	5	3	1,584
京都きもの友禅	11	2	2,388	フジ住宅	9	4	3,506
コロワイド	16	23	44,410	日本エスリード	2	0.7	1,067
壱番屋	4	3	13,967	日神不動産	4	—	—
トップカルチャー	2	1	723	日本エスコン	—	101	40,661
スギホールディングス	8	5	30,495	サンヨーハウジング名古屋	2	1	1,011
エー・ファミリーマートホールディングス	7	5	37,365	穴吹興産	3	0.6	1,601
木曽路	4	3	8,528	ランドビジネス	8	3	867
サトレストラシステムズ	20	6	5,190	サービス業(7.6%)			
タカキュー	3	2	513	ノバレーゼ	4	—	—
ケーヨー	8	3	2,164	アコーディア・ゴルフ	80	—	—
ロイヤルホールディングス	—	12	25,351	CDS	1	0.7	703
いなげや	1	1	1,880	エスクリ	4	2	2,054
島忠	7	5	14,504	アイ・ケイ・ケイ	3	2	1,436
チヨダ	10	5	14,284	スタジオアリス	4	2	6,072
リンガーハット	7	5	12,152	NJS	1	0.5	699
デンアライド	2	3	1,260	ルネサンス	2	2	4,089
コメリ	10	7	19,728	ツカタ・グローバルホールディング	2	3	2,055
しまむら	3	2	37,752	ディー・エヌ・エー	81	—	—
はせがわ	3	1	491	ジャパンベストレスキューシステム	22	14	3,617
東武ストア	4	0.2	604	ティア	4	2	1,809
平和堂	8	5	15,008	JPホールディングス	33	24	6,321
元気寿司	1	0.6	1,361	TAC	—	3	801
ニトリホールディングス	24	12	154,350	びあ	1	0.5	1,461
グルメ杵屋	4	3	3,123	イオンファンタジー	4	2	7,488
吉野家ホールディングス	51	24	40,817	みらかホールディングス	4	3	16,731
松屋フーズ	4	2	11,676	ダイオーズ	0.7	0.9	966
サガミチェーン	5	8	11,971	オリエンタルランド	25	26	169,295
関西スーパーマーケット	1	—	—	ダスキン	8	5	14,401
王将フードサービス	5	—	—	明光ネットワークジャパン	13	10	13,057

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
田谷	1	-	-
ラウンドワン	87	63	55,880
ワタベウェディング	1	1	744
早稲田アカデミー	1	0.5	599
ユー・エス・エス	51	36	69,588
テー・オー・ダブリュー	4	-	-
セントラルスポーツ	1	1	5,728
リソルホールディングス	4	5	1,750
サクセスホールディングス	0.8	0.8	1,104
アサンテ	2	1	2,256
ERIホールディングス	0.8	0.8	660
東祥	-	2	12,360
エイチ・アイ・エス	1	0.9	2,634
燦ホールディングス	0.5	0.5	795
スバル興業	6	4	2,080
東京テアトル	21	-	-
よみうりランド	12	9	4,158

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京都競馬	102	32	8,256
常磐興産	19	1	1,775
白洋舎	2	0.2	540
セコム	2	14	115,535
船井総研ホールディングス	2	-	-
進学会	-	1	571
学究社	3	4	7,972
ベネッセホールディングス	55	38	129,258
ステップ	1	1	1,822
合計	株数・金額 8,802	5,366	8,907,626
計	銘柄数 < 比率 >	416	433 <97.8%>

(注1) 銘柄欄の()内は、当期末における国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 株数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載しています。

(2)先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
国内	T O P I X	百万円 46	百万円 -
	ミ ニ T O P I X	4	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎投資信託財産の構成('17年2月20日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 8,907,626	% 97.8
コール・ローン等、その他	201,569	2.2
投資信託財産総額	9,109,195	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('17年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	9,109,149,823
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	162,148,305
株 式 (評 価 額)	8,907,626,700
未 収 入 金	14,332,218
未 収 配 当 金	22,758,500
差 入 委 託 証 抛 金	2,284,100
(B)負 債	3,722
未 払 利 息	275
そ の 他 未 払 費 用	3,447
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	9,109,146,101
元 本	4,109,484,262
次 期 繰 越 損 益 金	4,999,661,839
(D)受 益 権 総 口 数	4,109,484,262口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D × 10,000)	22,166円

- (注1) 期首元本額 5,960,565,593円
 期中追加設定元本額 1,315,179,187円
 期中一部解約元本額 3,166,260,518円
 (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。
 日本株式最小分散インデックス・ファンド〈適格機関投資家限定〉 3,986,871,411円
 ステート・ストリート日本株式最小分散インデックス・オープン 122,612,851円

◎損益の状況

当期 (自'16年2月23日 至'17年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	184,161,576
受 取 配 当 金	183,896,936
受 取 利 息	136
そ の 他 収 益 金	351,905
支 払 利 息	△ 87,401
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	782,983,399
売 買 益	1,249,867,531
売 買 損	△ 466,884,132
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	15,629,336
取 引 益	21,631,582
取 引 損	△ 6,002,246
(D)信 託 報 酬 等	△ 55,066
(E)当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	982,719,245
(F)前 期 繰 越 損 益 金	5,899,539,816
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	1,459,554,813
(H)解 約 差 損 益 金	△ 3,342,152,035
(I) 計 (E + F + G + H)	4,999,661,839
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	4,999,661,839

- (注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
 (注2) (G)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。
 (注3) (H)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

◎約款変更のお知らせ

・米国ボルカー・ルール¹⁾の適用により、2016年5月31日付で当該投資信託の名称変更を行いました。