

○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・グローバル・アドバイザーズ・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「SSGA トラスト・カンパニー」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、SSGA トラスト・カンパニー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	わが国の取引所に上場されている株式
組入制限	ベビーフンド	・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>	

STATE STREET GLOBAL ADVISORS

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3期 運用報告書 (全体版)
(決算日 2019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、厚く御礼申しあげます。

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、2019年2月20日に第3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あげます。

<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)	税込み 分配金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
(設 定 日)	円	円	%		%	%	%	百万円
'16年9月21日	10,000	-	-	10,000	-	-	-	9
1期('17年2月20日)	10,984	10	9.9	11,026	10.3	97.9	0.6	271
2期('18年2月20日)	12,978	0	18.2	13,017	18.1	96.9	0.9	483
3期('19年2月20日)	12,613	0	△ 2.8	12,720	△ 2.3	97.0	1.3	498

(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		
(期 首)	円	%		%	%	%
'18年2月20日	12,978	-	13,017	-	96.9	0.9
2月末	13,002	0.2	13,042	0.2	98.6	1.0
3月末	13,101	0.9	13,150	1.0	97.9	1.6
4月末	13,514	4.1	13,566	4.2	97.6	1.8
5月末	13,517	4.2	13,577	4.3	86.7	1.5
6月末	13,461	3.7	13,531	3.9	94.5	4.1
7月末	13,308	2.5	13,382	2.8	97.8	1.4
8月末	12,971	△ 0.1	13,040	0.2	97.1	2.1
9月末	13,584	4.7	13,664	5.0	97.4	2.0
10月末	12,680	△ 2.3	12,762	△ 2.0	97.6	1.7
11月末	13,035	0.4	13,128	0.9	112.2	2.0
12月末	12,031	△ 7.3	12,121	△ 6.9	97.3	2.1
'19年1月末	12,294	△ 5.3	12,396	△ 4.8	98.3	1.3
(期 末)						
'19年2月20日	12,613	△ 2.8	12,720	△ 2.3	97.0	1.3

(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。

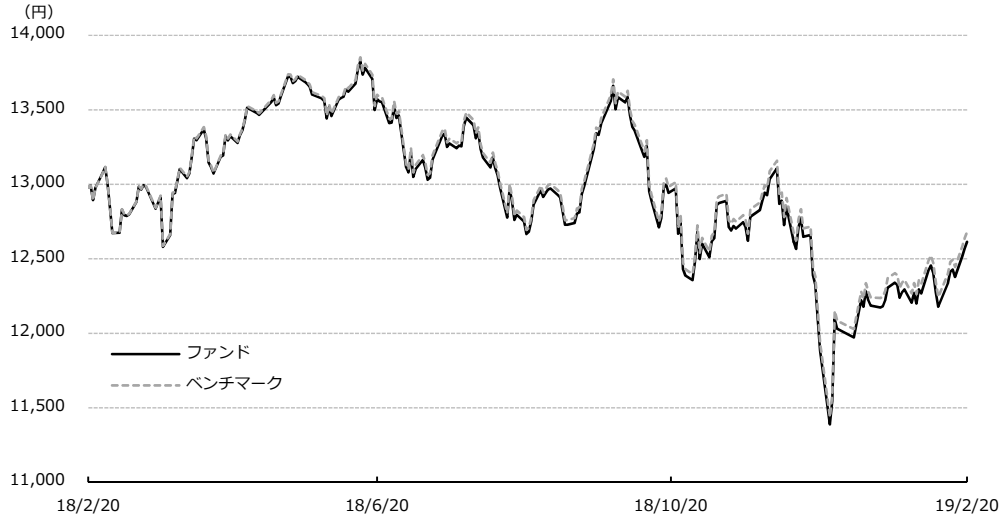
(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

(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

(2018年2月21日から2019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委託会社が独自に指数化したものです。

決算期	期首基準価額 (分配落ち)	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3期	12,978円	12,613円	0円	-2.8%	-2.3%

当期末の基準価額は12,613円となり、前期末の12,978円に比べて365円の下落となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

- 株式市場の上昇
 - 日米金利差を背景とした円安ドル高基調
 - 好調な企業業績

【マイナスの要因】

- 株式市場の下落
 - 米国の保護貿易主義と円高への警戒
 - 米長期金利の急上昇による市場センチメント悪化

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は-2.8%となり、ベンチマークの騰落率(-2.3%)を0.5%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】

- 当ファンドから投資したマザーファンドの収益率が、対ベンチマークで小幅下方乖離したこと。
- 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、見送りとしております。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。

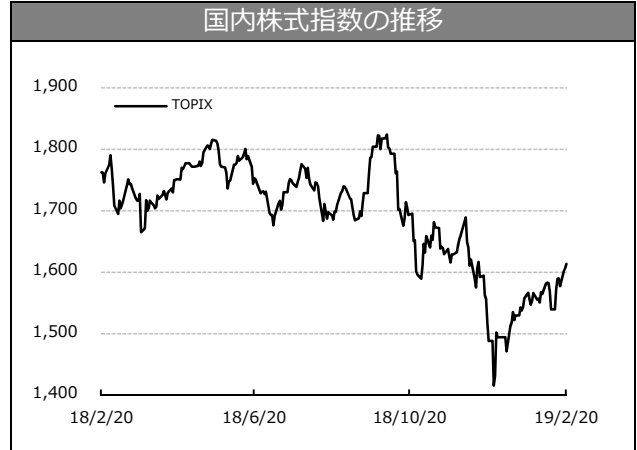
投資環境

(2018年2月21日から2019年2月20日まで)

国内株式市場

当期の株式市場は、米国のインフレ懸念の高まりから米長期金利が急上昇したことを受けて下落基調で始まりました。その後、トランプ米大統領が保護主義的な姿勢を強め貿易摩擦激化が懸念される中、円高ドル安の進行も相俟って上値の重い展開が続きました。4月以降は円安ドル高傾向や好調な企業決算を背景に比較的底堅い動きが続きました。しかし、10月に入ると米金利上昇による世界経済の減速懸念をきっかけにリスクオフの動きが鮮明化したことに加えて、米中貿易摩擦激化や中国景気減速懸念から国内企業の業績悪化が懸念されて大幅下落となりました。1月以降は米中貿易問題への過度な懸念の後退や為替の円安傾向から上昇基調で期末を迎えました。

国内株式指数の推移



運用の概況

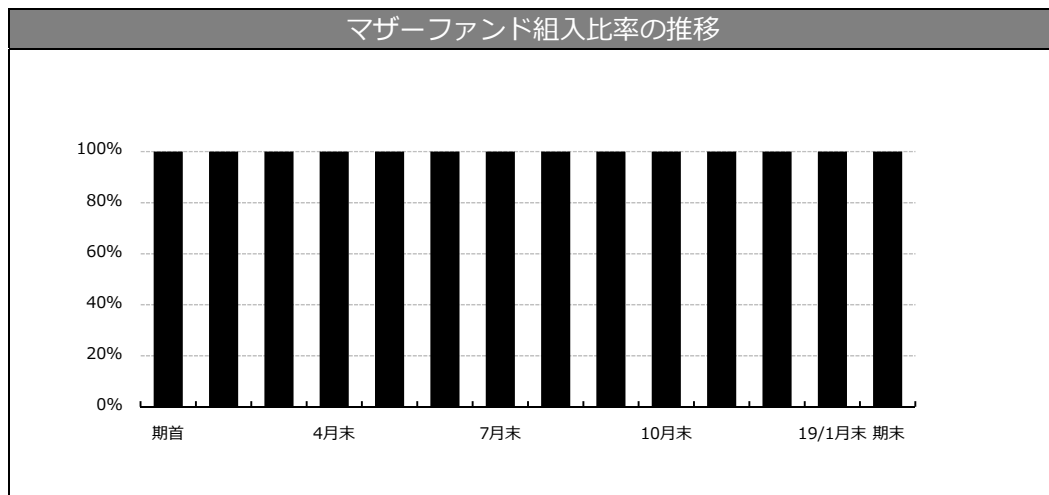
(2018年2月21日から2019年2月20日まで)

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

当期も、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 (2018年2月21日~2019年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	13,041円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	48円	0.367%	(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)	(42)	(0.324)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(1)	(0.011)	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)	(4)	(0.032)	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	8	0.060	(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)	(8)	(0.059)	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	2	0.012	(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)	(0.011)	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)	(0.001)	その他は、金銭信託手数料
合 計	58円	0.439%	

(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。

(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('18年2月21日から'19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 120,128	千円 318,748	千口 109,739	千円 296,308

(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	16,393,149 千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	6,842,021 千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	2.39

(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('18年2月21日から'19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
日本郵政	205	266,494	1,298	資生堂	32	260,398	8,086
NTTドコモ	56	155,622	2,769	JXTGホールディングス	328	246,747	752
みずほフィナンシャルグループ	864	153,393	177	キーエンス	2	157,121	60,431
すかいらーくホールディングス	92	153,015	1,661	花王	18	155,621	8,366
日本たばこ産業	51	148,696	2,904	オリエンタルランド	13	153,751	11,305
中国電力	100	144,409	1,436	NTTドコモ	49	139,320	2,843
日産自動車	132	142,114	1,073	ラウンドワン	85	124,576	1,462
オリエンタルランド	12	139,244	10,964	すかいらーくホールディングス	74	122,531	1,642
KDDI	47	137,875	2,878	KDDI	41	121,302	2,937
花王	17	137,655	7,956	日本郵政	93	119,341	1,270

(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('18年2月21日から'19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('19年2月20日現在)

○親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	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 183,903	千口 194,292	千円 498,516

(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2,973,329千口です。

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('19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 498,516	% 99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	987	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	499,503	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

(‘19年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	499,503,278
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	986,617
日本株式最小分散インデックス・マザーファンド(評価額)	498,516,661
(B)負 債	911,347
未 払 解 約 金	69,288
未 払 信 託 報 酬	818,031
そ の 他 未 払 費 用	24,028
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	498,591,931
元 本	395,307,345
次 期 繰 越 損 益 金	103,284,586
(D)受 益 権 総 口 数	395,307,345口
1 万口当たり基準価額(C/D×10,000)	12,613円

(注) 期首元本額	372,672,460円
期中追加設定元本額	269,928,024円
期中一部解約元本額	247,293,139円

◎損益の状況

当期 (自‘18年 2月 21 日 至‘19年 2月 20 日)

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	△ 259
支 払 利 息	△ 259
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 12,570,764
売 買 益	6,006,512
売 買 損	△ 18,577,276
(C)信 託 報 酬 等	△ 1,804,991
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 14,376,014
(E)前 期 繰 越 損 益 金	28,610,431
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	89,050,169
(配 当 等 相 当 額)	(43,908,361)
(売 買 損 益 相 当 額)	(45,141,808)
(G) 計 (D + E + F)	103,284,586
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	103,284,586
追 加 信 託 差 損 益 金	89,050,169
(配 当 等 相 当 額)	(44,335,311)
(売 買 損 益 相 当 額)	(44,714,858)
分 配 準 備 積 立 金	36,431,144
繰 越 損 益 金	△ 22,196,727

- (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)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越損益金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。
(注4) (F)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。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

◎1 万口当たり分配原資の内訳(税込み)

項 目	第3期 (2018年2月21日～ 2019年2月20日)
当期分配金	-円
(対基準価額比率)	-%
当期の収益	-円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	2,612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。

日本株式最小分散インデックス・マザーファンド

第 10 期 運用報告書 (決算日 2019 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 10 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・グローバル・アドバイザーズ・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「SSGA トラスト・カンパニー」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、SSGA トラスト・カンパニー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	%	円	%			
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
9期('18年2月20日)	26,296	18.6	26,668	18.1	96.9	0.9	6,912
10期('19年2月20日)	25,658	△ 2.4	26,061	△ 2.3	97.0	1.3	7,628

(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	%	円	%		
(期首) '18年2月20日	26,296	-	26,668	-	96.9	0.9
2月末	26,346	0.2	26,720	0.2	98.6	1.0
3月末	26,555	1.0	26,942	1.0	97.9	1.6
4月末	27,400	4.2	27,794	4.2	97.6	1.8
5月末	27,417	4.3	27,816	4.3	86.7	1.5
6月末	27,312	3.9	27,721	3.9	94.5	4.1
7月末	27,012	2.7	27,417	2.8	97.8	1.4
8月末	26,337	0.2	26,717	0.2	97.2	2.1
9月末	27,590	4.9	27,995	5.0	97.5	2.0
10月末	25,764	△ 2.0	26,146	△ 2.0	97.6	1.7
11月末	26,494	0.8	26,897	0.9	112.3	2.0
12月末	24,461	△ 7.0	24,833	△ 6.9	97.3	2.1
'19年1月末	25,004	△ 4.9	25,396	△ 4.8	98.3	1.3
(期末) '19年2月20日	25,658	△ 2.4	26,061	△ 2.3	97.0	1.3

(注1) 騰落率は期首比です。

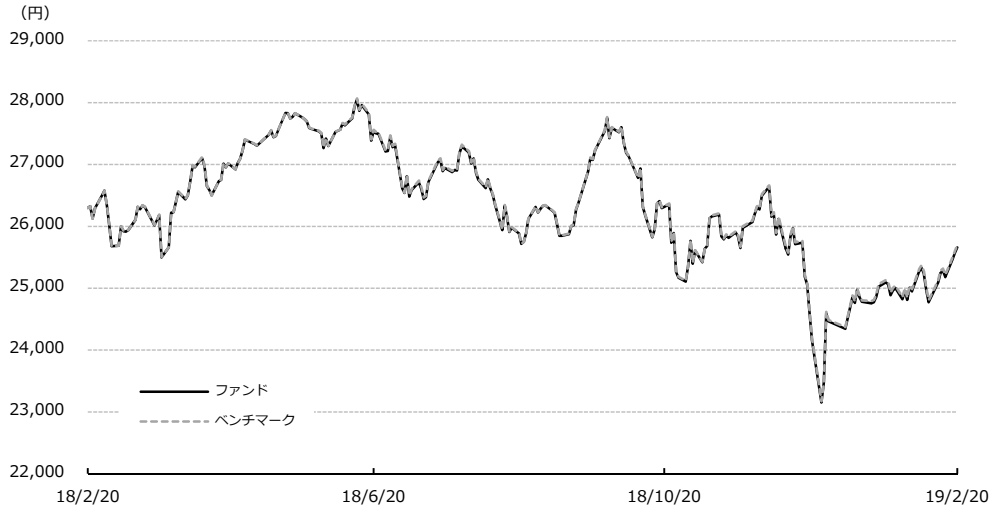
(注2) ベンチマークは、日本株式最小分散インデックスで、ファンド設定日の前営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

当期の運用実績

(2018年2月21日から2019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25,658円となり、前期末の26,296円に比べて638円の下落となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

- 株式市場の上昇
 - 日米金利差を背景とした円安ドル高基調
 - 好調な企業業績

【マイナスの要因】

- 株式市場の下落
 - 米国の保護貿易主義と円高への警戒
 - 米長期金利の急上昇による市場センチメント悪化

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は-2.4%となり、ベンチマークの騰落率(-2.3%)を0.1%下回りましたが、当期の運用実績はベンチマークにほぼ連動した結果となりました。

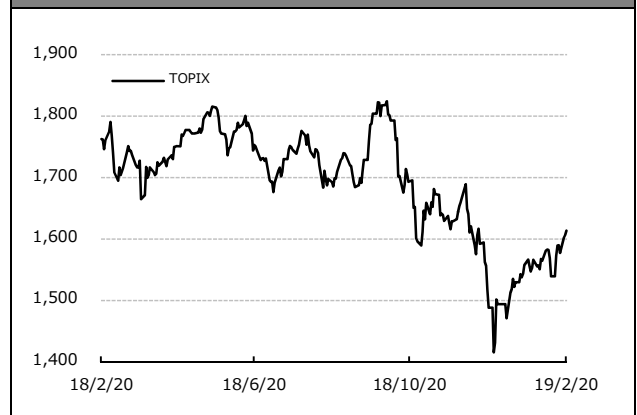
投資環境

(2018年2月21日から2019年2月20日まで)

国内株式市場

当期の株式市場は、米国のインフレ懸念の高まりから米長期金利が急上昇したことを受けて下落基調で始まりました。その後、トランプ米大統領が保護主義的な姿勢を強め貿易摩擦激化が懸念される中、円高ドル安の進行も相俟って上値の重い展開が続きました。4月以降は円安ドル高傾向や好調な企業決算を背景に比較的底堅い動きが続きました。しかし、10月に入ると米金利上昇による世界経済の減速懸念をきっかけにリスクオフの動きが鮮明化したことに加えて、米中貿易摩擦激化や中国景気減速懸念から国内企業の業績悪化が懸念されて大幅下落となりました。1月以降は米中貿易問題への過度な懸念の後退や為替の円安傾向から上昇基調で期末を迎えました。

国内株式指数の推移



運用の概況

(2018年2月21日から2019年2月20日まで)

当マザーファンドは、当期中、わが国の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 (2018年2月21日~2019年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	26,474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)	16円 (15) (0)	0.059% (0.058) (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) その他費用 (そ の 他)	0 (0)	0.001 (0.001)	(b) 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	16円	0.060%	

(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('18年2月21日から'19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
		4,890	8,687,019	3,453	7,706,129
		(△123)	(-)		

(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 966	百万円 927	百万円 -	百万円 -

(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	16,393,149 千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	6,842,021 千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	2.39

(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('18年2月21日から'19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
日本郵政	千株 205	千円 266,494	円 1,298	資生堂	千株 32	千円 260,398	円 8,086
N T T ドコモ	56	155,622	2,769	J X T Gホールディングス	328	246,747	752
みずほフィナンシャルグループ	864	153,393	177	キーエンス	2	157,121	60,431
すかいらーくホールディングス	92	153,015	1,661	花王	18	155,621	8,366
日本たばこ産業	51	148,696	2,904	オリエンタルランド	13	153,751	11,305
中国電力	100	144,409	1,436	N T T ドコモ	49	139,320	2,843
日産自動車	132	142,114	1,073	ラウンドワン	85	124,576	1,462
オリエンタルランド	12	139,244	10,964	すかいらーくホールディングス	74	122,531	1,642
K D D I	47	137,875	2,878	K D D I	41	121,302	2,937
花王	17	137,655	7,956	日本郵政	93	119,341	1,270

(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('18年2月21日から'19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('19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	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業(1.3%)				鳥越製粉	1	1	863
極洋	1	1	4,485	フィード・ワン	5	-	-
マルハニチロ	12	15	56,240	東洋精糖	0.3	0.7	716
サカタのタネ	6	5	20,487	三井製糖	2	3	9,500
ホクト	3	6	12,850	塩水港精糖	1	4	967
ホクリヨウ	0.8	1	627	日新製糖	0.8	0.5	1,034
鉱業(1.4%)				中村屋	0.2	0.3	1,276
国際石油開発帝石	80	92	106,027	名糖産業	0.6	0.4	564
建設業(5.1%)				不二家	1	1	3,603
ショーボンドホールディングス	3	1	11,865	第一屋製パン	0.3	-	-
タマホーム	7	1	2,145	モロゾフ	-	0.1	503
サンヨーホームズ	1	0.6	516	ヤクルト本社	1	2	16,324
コムシスホールディングス	16	19	56,217	明治ホールディングス	10	12	107,379
ヤマウラ	1	1	1,373	プリマハム	25	-	-
大成建設	8	10	50,803	日本ハム	1	0.3	1,282
不動テトラ	-	7	12,196	丸大食品	7	2	4,634
西松建設	14	12	31,099	S Foods	4	4	16,540
三井住友建設	34	39	27,440	伊藤ハム米久ホールディングス	16	19	12,911
佐田建設	-	1	601	アサヒグループホールディングス	2	3	15,452
東鉄工業	1	-	-	キリンホールディングス	15	17	46,030
熊谷組	3	3	11,754	オエノンホールディングス	6	6	2,368
植木組	-	0.2	469	養命酒製造	0.4	0.4	843
三井ホーム	2	-	-	サントリー食品インターナショナル	21	24	122,255
大東建託	2	2	40,781	タイドグループホールディングス	1	4	21,720
前田道路	9	-	-	伊藤園	8	9	47,380
東洋建設	9	-	-	キーコーヒー	2	3	6,342
西部電気工業	0.2	-	-	ユニカフェ	0.4	0.6	608
四電工	0.1	0.3	807	ジャパンフーズ	0.3	0.5	627
きんでん	14	17	30,968	日清オイリオグループ	2	3	10,540
協和エクシオ	18	20	60,402	不二製油グループ本社	3	3	15,307
NDS	0.2	-	-	J-オイルミルズ	0.9	1	4,055
大気社	3	3	12,141	味の素	43	49	83,265
東芝プラントシステム	10	10	20,961	キュービー	13	16	41,024
東洋エンジニアリング	9	1	999	ハウス食品グループ本社	10	11	51,504
新興プランテック	3	3	4,708	カゴメ	11	13	40,593
食料品(13.8%)				焼津水産化学工業	0.5	1	1,173
日東富士製粉	0.1	0.1	641	アリアケジャパン	2	0.8	4,712
昭和産業	-	1	3,636	ピエトロ	0.2	0.4	656

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エバラ食品工業	0.4	0.4	848
ニチレイ	10	11	32,350
イトアアンド	1	1	2,879
大冷	0.4	0.6	1,043
日清食品ホールディングス	12	13	107,586
永谷園ホールディングス	2	0.8	1,920
一正蒲鉾	0.2	-	-
フジッコ	2	2	5,539
ロック・フィールド	2	3	5,009
日本たばこ産業	38	54	152,940
ケンコーマヨネーズ	0.9	-	-
わらべや日洋ホールディングス	2	2	4,970
なとり	-	1	1,691
理研ビタミン	0.5	0.5	1,802
繊維製品(0.4%)			
シキボウ	2	1	1,652
トーア紡コーポレーション	1	1	506
ダイドーリミテッド	3	5	1,977
東レ	13	15	12,498
日本フエルト	0.6	0.6	274
イチカワ	1	0.2	280
日東製網	-	0.2	263
アツギ	-	2	2,112
ソトー	0.6	0.7	685
東海染工	-	0.2	208
オンワードホールディングス	7	8	5,669
キング	0.5	1	734
ヤマトインターナショナル	1	1	470
パルプ・紙(0.8%)			
日本製紙	23	27	55,787
化学(2.4%)			
日東エフシー	-	1	1,393
信越化学工業	1	-	-
エア・ウォーター	8	-	-
アイカ工業	2	-	-
花王	18	17	142,408
ニイタカ	0.4	0.1	148
関西ペイント	4	-	-
資生堂	18	-	-
ライオン	3	4	10,039
コタ	0.3	0.4	602

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シーズ・ホールディングス	7	-	-
シーボン	0.2	0.2	534
ノエビアホールディングス	2	-	-
アジバンコスメジャパン	1	1	1,370
小林製薬	7	-	-
日本高純度化学	0.2	0.2	475
アース製薬	4	3	14,985
大成ラミック	0.5	0.4	1,149
前澤化成工業	0.4	0.4	401
エフピコ	0.9	1	6,550
医薬品(4.3%)			
武田薬品工業	21	22	102,866
アステラス製薬	21	24	41,650
田辺三菱製薬	5	5	9,309
ビオフェルミン製薬	-	0.1	239
小野薬品工業	0.1	0.1	228
持田製薬	0.9	1	11,490
参天製薬	17	20	31,536
扶桑薬品工業	0.4	0.3	772
ツムラ	13	14	51,757
キッセイ薬品工業	4	0.9	2,628
日水製薬	1	1	1,774
沢井製薬	-	7	47,479
大幸薬品	2	1	2,569
大塚ホールディングス	2	2	12,692
石油・石炭製品(0.0%)			
ビーピー・カストロール	1	1	1,635
JXTGホールディングス	186	-	-
ゴム製品(0.7%)			
ブリヂストン	9	11	50,125
住友ゴム工業	0.8	0.9	1,282
ガラス・土石製品(0.9%)			
住友大阪セメント	129	14	69,310
ヨータイ	1	-	-
鉄鋼(0.5%)			
丸一鋼管	10	12	40,232
非鉄金属(0.1%)			
カナレ電気	0.5	0.4	734
アサヒホールディングス	2	2	6,293
金属製品(0.4%)			
稲葉製作所	1	2	2,572

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アルインコ	1	1	1,693
LIXILグループ	0.7	-	-
長府製作所	-	1	2,211
リンナイ	2	2	19,162
ダイニチ工業	0.5	0.9	657
三洋工業	0.2	0.4	753
岡部	2	2	2,332
中国工業	0.3	0.3	168
モリテック スチール	25	7	3,196
機械(2.6%)			
日本ドライケミカル	0.1	1	1,210
フリユー	-	1	1,974
オイレス工業	2	0.9	1,747
日工	-	0.3	644
巴工業	1	1	2,624
荏原実業	0.2	0.4	890
平和	13	26	58,626
SANKYO	2	20	82,316
マースグループホールディングス	0.8	1	2,856
ダイコク電機	-	1	2,842
セガサミーホールディングス	3	27	35,705
前澤給装工業	0.4	0.4	742
電気機器(4.5%)			
日本電産	2	1	13,400
不二電機工業	0.2	0.3	390
テクノメディカ	-	0.4	840
日本電気	-	27	102,136
岩崎通信機	-	0.9	738
電気興業	1	0.4	1,064
ナカヨ	0.4	0.3	423
アイホン	0.9	1	2,285
マクセルホールディングス	4	-	-
アイコム	-	1	3,369
アズビル	6	15	37,339
日本光電工業	-	12	43,029
チノー	0.2	-	-
共和電業	-	0.8	299
小野測器	0.5	0.5	307
キーエンス	2	-	-
コーセル	7	1	2,226
岡谷電機産業	0.6	-	-

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キヤノン電子	1	2	3,684
キヤノン	33	37	122,189
MUTOHホールディングス	-	0.3	561
輸送用機器(2.1%)			
日産自動車	-	98	93,188
レシップホールディングス	0.4	1	1,090
シマノ	0.6	3	60,025
精密機器(0.1%)			
クリエートメディック	0.3	0.3	299
JMS	-	0.4	255
リズム時計工業	0.3	0.3	497
大研医器	2	4	2,528
シンシア	-	0.6	287
松風	0.5	0.8	1,037
その他製品(1.7%)			
スノーピーク	0.2	0.4	556
パラマウントベッドホールディングス	1	1	8,016
SHO-BI	-	0.7	254
永大産業	1	1	438
バンドイナムコホールディングス	8	9	45,600
共立印刷	4	5	1,115
フランスベッドホールディングス	-	3	2,598
エステールホールディングス	0.3	0.3	201
光村印刷	0.1	0.1	220
宝印刷	1	1	1,988
ツツミ	-	0.5	995
小松ウオール工業	0.3	0.5	968
キングジム	6	4	3,877
任天堂	1	1	32,642
コクヨ	10	11	19,650
グローブライド	0.9	-	-
美津濃	-	1	3,127
電気・ガス業(6.0%)			
中国電力	45	99	145,629
北陸電力	29	33	31,180
東北電力	27	32	47,616
九州電力	-	73	98,002
沖縄電力	3	5	11,558
電源開発	14	17	48,341
大阪瓦斯	14	16	36,128
東邦瓦斯	3	4	22,297

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
北海道瓦斯	6	1	2,042
広島ガス	-	4	1,587
陸運業(3.8%)			
京浜急行電鉄	13	-	-
京王電鉄	3	4	28,890
富士急行	2	2	11,116
新京成電鉄	0.2	0.5	1,039
東日本旅客鉄道	0.7	0.8	8,496
西日本旅客鉄道	8	9	77,568
東海旅客鉄道	0.9	1	24,835
阪急阪神ホールディングス	6	7	28,875
南海電気鉄道	9	10	32,656
京阪ホールディングス	4	4	21,502
神戸電鉄	0.4	1	3,965
名古屋鉄道	9	11	33,633
山陽電気鉄道	0.7	3	6,785
丸運	0.6	0.6	182
丸全昭和運輸	2	0.6	1,710
日本石油輸送	0.4	0.2	594
神奈川中央交通	0.2	0.7	2,621
空運業(0.8%)			
日本航空	12	13	56,166
倉庫・運輸関連業(0.0%)			
澁澤倉庫	0.5	0.5	828
東陽倉庫	1	1	382
中央倉庫	0.2	0.2	211
東洋埠頭	-	0.2	298
キムラユニティー	0.4	0.9	1,001
エーアイティー	0.7	0.7	751
情報・通信業(10.2%)			
NECネットエスアイ	3	4	10,418
システナ	4	-	-
キューブシステム	0.4	-	-
電算システム	0.5	0.5	1,257
グリー	15	17	8,323
三菱総合研究所	0.7	-	-
電算	0.1	0.1	221
ティーガイア	2	3	6,268
ザッパラス	1	2	1,108
朝日ネット	1	1	877
AOI TYO Holdings	5	-	-

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
マクロミル	1	-	-
ハイマックス	0.1	0.3	549
野村総合研究所	3	3	17,277
東邦システムサイエンス	-	1	911
フジ・メディア・ホールディングス	-	22	36,758
ヤフー	193	222	68,598
トレンドマイクロ	1	2	11,594
日本オラクル	6	6	57,270
CAC Holdings	1	1	2,160
伊藤忠テクノソリューションズ	3	-	-
東計電算	0.4	0.4	1,226
エックスネット	0.3	1	846
大塚商会	5	12	49,999
C I J	2	2	2,027
東洋ビジネスエンジニアリング	0.1	0.3	592
WOWOW	-	1	5,134
ネットワンシステムズ	9	-	-
マーベラス	-	7	6,349
日本テレビホールディングス	3	4	7,547
朝日放送グループホールディングス	-	2	1,700
スカパーJ SATホールディングス	-	29	14,840
日本BS放送	1	1	1,066
クロップス	0.3	0.3	199
日本電信電話	23	27	126,846
KDDI	43	50	136,196
NTTドコモ	50	57	150,192
アイトマーケティングコミュニケーション	-	4	2,226
昭文社	0.5	0.5	245
アイネット	0.5	-	-
松竹	1	1	19,431
エヌ・ティ・ティ・データ	13	-	-
ピー・シー・エー	0.2	0.4	938
卸売業(4.9%)			
高千穂交易	0.2	-	-
伊藤忠食品	0.4	0.4	1,952
東京エレクトロン デバイス	0.7	-	-
フィールズ	-	7	5,198
横浜冷凍	10	12	11,692
ペッパーフードサービス	1	-	-
バイタルケ-エスケー-ホールディングス	2	10	11,356
八洲電機	-	1	1,577

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
UKCホールディングス	5	0.9	1,848
大光	-	1	674
TOKAIホールディングス	16	18	16,650
ミタチ産業	0.5	-	-
デリカフーズホールディングス	0.7	0.9	1,210
コメダホールディングス	28	16	35,474
富士興産	-	1	869
エコートレーディング	1	0.4	239
中山福	0.8	0.9	499
三菱食品	-	1	3,754
メディカルホールディングス	5	6	16,695
SPK	0.2	0.4	924
尾家産業	0.3	0.3	382
シモジマ	0.3	0.3	340
ドウシシャ	2	3	5,526
小津産業	0.4	0.4	748
高速	0.4	0.4	473
たけびし	0.4	0.4	580
橋本総業ホールディングス	0.2	0.2	298
タカシヨー	-	1	813
蝶理	0.5	0.6	951
三共生興	-	0.9	395
ツカモトコーポレーション	0.7	0.4	408
東都水産	0.1	0.6	1,531
OUGホールディングス	0.2	0.5	1,253
スターゼン	0.9	1	4,020
内田洋行	0.9	0.4	941
キャノンマーケティングジャパン	4	5	10,560
正栄食品工業	2	-	-
フルサト工業	0.3	-	-
イワキ	7	-	-
GSIクレオス	-	1	1,578
東邦ホールディングス	2	2	7,061
サンゲツ	4	7	15,048
シナネンホールディングス	0.5	0.5	1,108
伊藤忠エネクス	6	7	6,825
サンリオ	9	18	43,148
トーヨー	0.3	0.5	1,048
東陽テクニカ	-	2	1,873
モスフードサービス	5	10	29,521
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.1	0.4	479

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トラスコ中山	9	9	29,234
オートバックスセブン	13	20	38,007
加藤産業	0.8	1	5,880
イエローハット	1	2	6,165
因幡電機産業	2	2	10,396
タキヒヨー	0.2	0.6	1,089
蔵王産業	0.5	0.7	926
スズケン	3	3	23,439
小売業(14.9%)			
ローソン	4	5	36,666
エービーシー・マート	12	13	83,709
アスクル	-	8	20,111
ゲオホールディングス	10	-	-
ジーフット	1	1	1,231
くらコーポレーション	9	7	41,662
キャンドウ	1	1	2,367
あみやき亭	0.3	0.3	1,105
ひらまつ	2	-	-
大黒天物産	0.1	0.1	410
ハニーズホールディングス	0.5	0.5	477
アルペン	3	4	6,584
DCMホールディングス	-	36	41,068
きちりホールディングス	0.9	0.5	363
ドトール・日レスホールディングス	5	6	13,146
物語コーポレーション	1	-	-
丸善CHIホールディングス	2	4	1,444
エー・ピーカンパニー	-	0.6	298
チムニー	0.9	1	4,249
鳥貴族	2	-	-
ホットランド	2	3	4,910
すかいらーくホールディングス	64	81	139,721
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	7	1	1,643
ブックオフコーポレーション	1	-	-
あさひ	-	6	10,412
コスモス薬品	0.9	0.3	6,327
一六堂	0.8	-	-
セブン&アイ・ホールディングス	15	17	89,070
フェリシモ	0.3	0.3	340
トリドールホールディングス	14	-	-
ダイユー・リックホールディングス	0.8	-	-
スシローグローバルホールディングス	11	10	78,480

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
はるやまホールディングス	0.3	0.3	256
カップ・クリエイト	5	9	13,837
ライトオン	4	3	3,159
三城ホールディングス	1	1	765
ハウス オブ ローゼ	0.3	0.3	549
イオン北海道	2	1	1,495
ヒマラヤ	1	0.6	596
ワタミ	2	2	4,040
マルシェ	1	1	1,314
西松屋チェーン	13	11	10,840
ゼンショーホールディングス	19	22	57,182
幸楽苑ホールディングス	1	-	-
ハークスレイ	0.4	0.4	455
サイゼリヤ	4	5	10,717
魚力	1	1	2,339
ポブラ	0.4	0.4	228
フジ・コーポレーション	0.8	0.9	1,901
京都きもの友禅	3	2	968
コロワイド	9	10	24,575
壺番屋	2	2	11,132
トップカルチャー	1	1	508
スギホールディングス	3	4	19,992
ヴィア・ホールディングス	-	5	3,596
木曽路	2	5	15,222
S R Sホールディングス	4	6	6,197
ケーヨー	3	3	2,067
ロイヤルホールディングス	12	8	21,789
島忠	3	3	11,365
チヨダ	2	2	5,483
リンガーハット	4	4	11,662
テナアライド	2	2	1,159
コメリ	4	5	13,935
しまむら	1	1	17,423
はせがわ	0.5	1	430
東武ストア	0.2	-	-
ブックオフグループホールディングス	-	1	1,264
ヤマダ電機	-	90	48,343
ニトリホールディングス	5	6	92,730
グルメ杵屋	3	3	3,890
吉野家ホールディングス	16	25	46,350
松屋フーズホールディングス	1	1	5,159

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サガミホールディングス	2	4	5,604
王将フードサービス	1	2	19,188
プレナス	5	6	10,824
ミニストップ	2	3	6,134
藤久	0.2	0.5	372
大庄	1	1	2,344
ヤマザワ	0.2	0.3	535
銀行業(4.2%)			
島根銀行	0.2	0.5	350
ゆうちょ銀行	-	67	85,302
あおぞら銀行	-	20	65,670
みちのく銀行	0.2	2	3,535
鳥取銀行	-	0.6	838
みずほフィナンシャルグループ	-	832	146,616
長野銀行	-	0.6	932
中京銀行	-	2	5,829
トマト銀行	-	0.2	212
証券・商品先物取引業(0.1%)			
丸三証券	-	9	7,353
保険業(0.0%)			
アドバンスクリエイト	0.5	1	1,730
不動産業(0.5%)			
日本駐車場開発	70	63	9,873
パーク24	5	5	15,451
東京楽天地	0.3	0.3	1,390
フジ住宅	3	3	2,884
日本エスコン	1	-	-
サンヨーハウジング名古屋	0.7	1	1,414
ファースト住建	-	0.8	988
穴吹興産	0.2	0.2	570
ランドビジネス	0.8	1	1,060
サービス業(11.5%)			
中広	0.4	0.8	464
コシダカホールディングス	5	-	-
CDS	0.4	-	-
エスクリ	1	1	996
アイ・ケイ・ケイ	1	2	1,715
スタジオアリス	1	2	5,678
NJS	0.3	0.3	453
ルネサンス	1	3	7,422
ツカダ・グローバルホールディング	6	7	4,712

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
プラス	-	0.9	520
ジャパンベストレスキューシステム	29	-	-
ティア	1	0.7	467
CDG	0.3	0.6	753
J Pホールディングス	15	11	3,294
T A C	0.9	2	524
ケネディクス	26	30	16,830
びあ	0.3	0.4	1,614
イオンファンタジー	1	-	-
みらかホールディングス	2	2	7,625
ダイオーズ	0.2	0.2	275
オリエンタルランド	13	12	156,019
ダスキン	3	4	11,924
明光ネットワークジャパン	3	8	7,826
ファルコホールディングス	-	0.3	428
ラウンドワン	46	-	-
リゾートトラスト	16	18	29,481
リソー教育	13	37	18,484
早稲田アカデミー	-	0.5	850
ユー・エス・エス	23	26	54,028
テー・オー・ダブリュー	2	2	1,840
セントラルスポーツ	1	2	8,376
リソルホールディングス	0.4	0.4	1,704
キャリアリンク	-	0.7	274
アサンテ	1	1	2,432
ライドオンエクスプレスホールディングス	4	0.4	484
E R Iホールディングス	0.2	-	-
日本ビューホテル	1	1	1,357
日本郵政	-	111	150,922

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
一蔵	0.7	0.9	563
キュービーネットホールディングス	-	3	8,076
リログループ	4	-	-
東祥	3	3	12,250
エイチ・アイ・エス	18	15	66,572
共立メンテナンス	9	11	60,455
燦ホールディングス	0.4	0.3	759
東京テアトル	-	2	2,846
タナベ経営	0.2	0.4	490
よみうりランド	0.9	1	5,124
東京都競馬	2	2	8,211
常磐興産	0.9	1	2,082
東京ドーム	6	16	16,039
藤田観光	1	1	5,080
白洋舎	0.4	0.3	868
セコム	9	10	100,901
セントラル警備保障	1	-	-
進学会ホールディングス	0.4	1	656
オオバ	2	2	1,679
学究社	1	1	1,496
ベネッセホールディングス	18	18	56,019
ステップ	0.4	1	2,291
合計	株数・金額 2,845	4,159	7,399,181
計	銘柄数 < 比率 > 434	443	< 97.0% >

(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 96	百万円 -

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎投資信託財産の構成('19年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 7,399,181	% 97.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	229,689	3.0
投 資 信 託 財 産 総 額	7,628,870	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

('19年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	7,628,870,574
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	114,737,155
株 式 (評 価 額)	7,399,181,410
未 収 入 金	96,001,159
未 収 配 当 金	18,775,850
差 入 委 託 証 拠 金	175,000
(B)負 債	3,503
未 払 利 息	112
そ の 他 未 払 費 用	3,391
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	7,628,867,071
元 本	2,973,329,587
次 期 繰 越 損 益 金	4,655,537,484
(D)受 益 権 総 口 数	2,973,329,587口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D × 10,000)	25,658円

(注1) 期首元本額 2,628,878,858円
 期中追加設定元本額 2,795,801,764円
 期中一部解約元本額 2,451,351,035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> 2,779,036,711円
 スタート・ストリート日本株式最小分散インデックス・オープン 194,292,876円

◎損益の状況

当期 (自'18年2月21日 至'19年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	133,880,331
受 取 配 当 金	133,655,885
受 取 利 息	51
そ の 他 収 益 金	363,804
支 払 利 息	△ 139,409
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 282,767,032
売 買 益	535,549,407
売 買 損	△ 818,316,439
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 7,966,264
取 引 益	18,093,544
取 引 損	△ 26,059,808
(D)そ の 他 費 用	△ 54,461
(E)当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	△ 156,907,426
(F)前 期 繰 越 損 益 金	4,284,115,639
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	4,732,596,236
(H)解 約 差 損 益 金	△ 4,204,266,965
(I) 計 (E + F + G + H)	4,655,537,484
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	4,655,537,484

(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。