

○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>	

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4期 運用報告書 (全体版)
(決算日 2020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、2020年2月20日に第4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
	(分配額)	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
4期('20年2月20日)	12,397	0	△ 1.7	12,527	△ 1.5	87.0	1.5	405

(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	%		%	%	%
'19年2月20日	12,613	-	12,720	-	97.0	1.3
2月末	12,633	0.2	12,743	0.2	98.3	1.3
3月末	12,637	0.2	12,751	0.2	97.2	2.1
4月末	12,383	△ 1.8	12,488	△ 1.8	97.1	2.2
5月末	11,912	△ 5.6	12,020	△ 5.5	97.0	2.1
6月末	11,923	△ 5.5	12,031	△ 5.4	96.7	2.6
7月末	11,957	△ 5.2	12,067	△ 5.1	98.1	1.4
8月末	11,812	△ 6.4	11,929	△ 6.2	98.0	1.4
9月末	12,333	△ 2.2	12,458	△ 2.1	97.2	2.1
10月末	12,694	0.6	12,821	0.8	97.5	1.9
11月末	12,828	1.7	12,962	1.9	97.6	1.9
12月末	12,892	2.2	13,026	2.4	97.5	1.7
'20年1月末	12,592	△ 0.2	12,725	0.0	97.6	1.5
(期 末)						
'20年2月20日	12,397	△ 1.7	12,527	△ 1.5	87.0	1.5

(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。

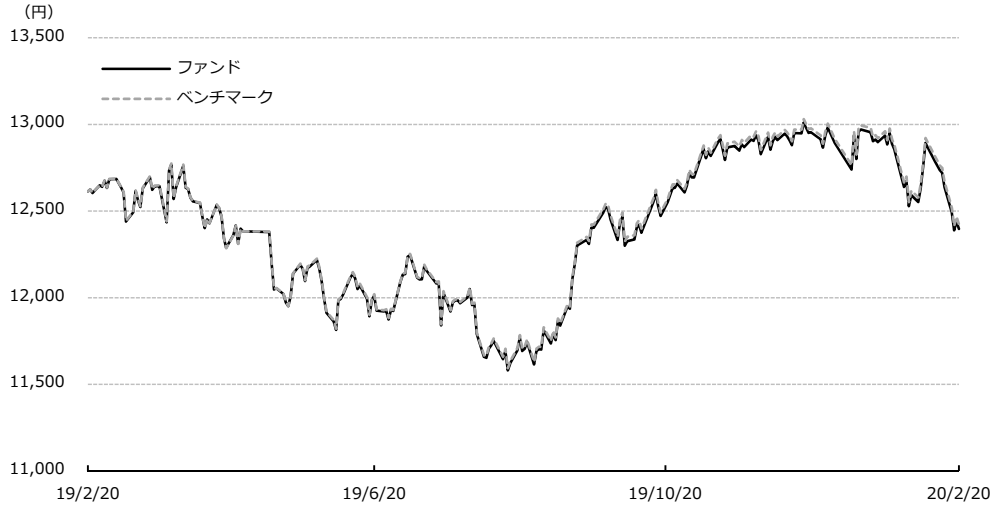
(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

(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

(2019年2月21日から2020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4期	12,613円	12,397円	0円	-1.7%	-1.5%

当期末の基準価額は12,397円となり、前期末の12,613円に比べて216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
 - 米中貿易協議進展への期待
 - 企業業績の改善期待

【マイナスの要因】

- 株式市場の下落
 - 米国による対中追加関税
 - 新型コロナウイルス感染拡大による経済への影響に対する懸念

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は-1.7%となり、ベンチマークの騰落率(-1.5%)を0.2%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、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。

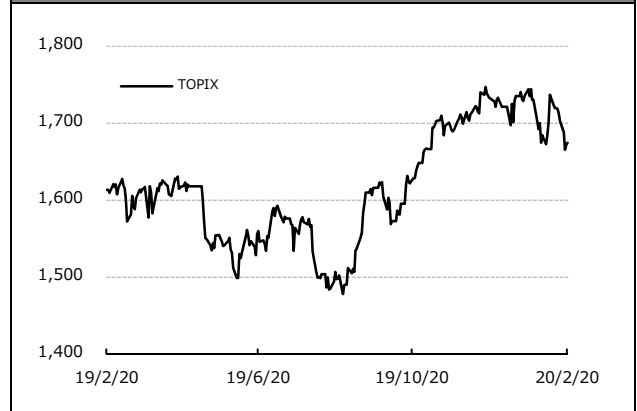
投資環境

(2019年2月21日から2020年2月20日まで)

国内株式市場

当期の株式市場は、欧米の利下げ観測が相場を支える中、米中貿易問題の動向を巡って一喜一憂する展開で始まりました。8月、トランプ米大統領が中国への追加関税第4弾を示唆したことから大幅下落となりましたが、9月に入り米中通商協議再開が報じられると反発しました。その後も10月中旬の米中通商協議の部分合意を受けて貿易摩擦への懸念が後退したことや、米株高、円安ドル高傾向、企業業績の改善期待などを背景に上昇基調となりました。しかし、1月下旬以降は新型コロナウイルス感染拡大による経済への影響に対する懸念が強まったことや低調な企業業績、国内GDPの悪化などを受けて軟調な展開で期末を迎えました。

国内株式指数の推移



運用の概況

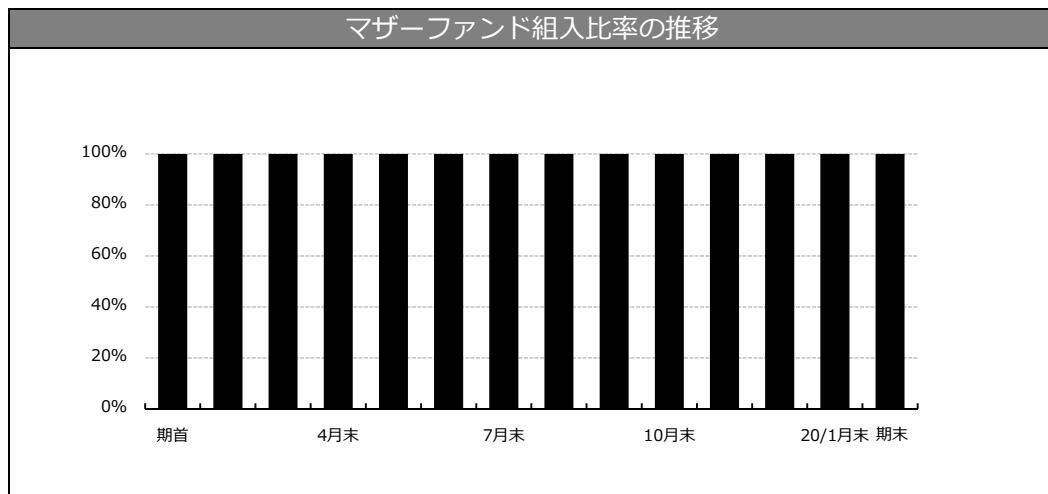
(2019年2月21日から2020年2月20日まで)

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 (2019年2月21日~2020年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	12,383円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	46円	0.374%	(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)	(41)	(0.330)	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)	(0.033)	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	5	0.038	(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)	(5)	(0.037)	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	0.012	(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	52円	0.424%	

(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。

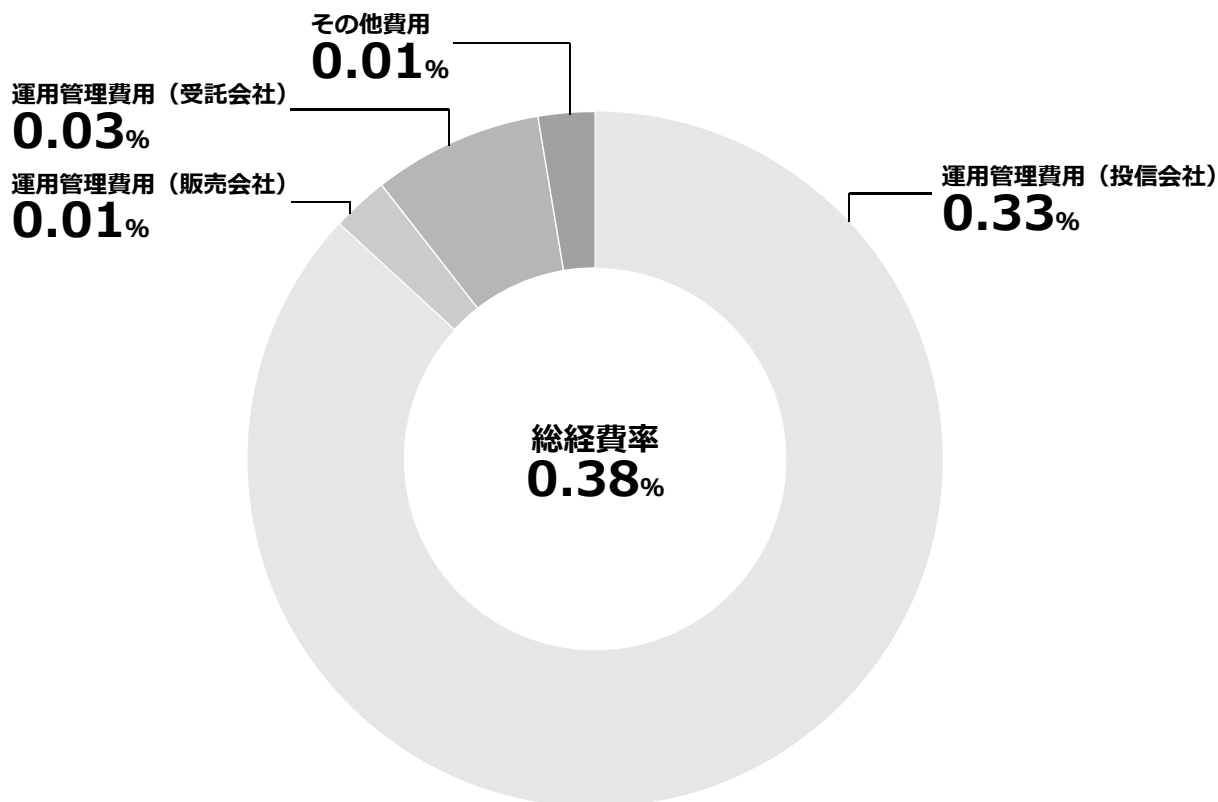
(注3) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

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、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した**総経費率(年率)は0.38%です。**



(注1) 費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 費用はマザーファンドが支払った費用を含みます。

(注5) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

◎売買および取引の状況('19年2月21日から'20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 36,816	千円 93,345	千口 70,924	千円 177,261

(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	5,529,917 千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	6,295,976 千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.87

(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('19年2月21日から'20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
ソフトバンク	86	127,125	1,471	オリエンタルランド	7	105,363	14,633
東京瓦斯	40	120,284	3,007	KDDI	31	93,549	2,951
ANAホールディングス	30	114,877	3,741	国際石油開発帝石	92	91,378	986
積水ハウス	58	110,589	1,906	武田薬品工業	19	87,891	4,438
ヤマダ電機	182	95,401	522	中国電力	60	83,919	1,394
ディー・エヌ・エー	48	91,112	1,874	NTTドコモ	29	80,969	2,782
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	20	71,862	3,593	すかいらーくホールディングス	38	74,708	1,930
近鉄グループホールディングス	11	68,983	5,796	セブン&アイ・ホールディングス	16	68,215	4,109
ゆうちょ銀行	52	65,330	1,234	日産自動車	98	65,208	663
神戸物産	13	53,212	3,971	ヤマダ電機	109	58,007	531

(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('19年2月21日から'20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('20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 194,292	千口 160,185	千円 405,524

(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2,066,041千口です。

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('20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 405,524	% 99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,013	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	406,537	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

('20年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	406,537,905
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,013,549
日本株式最小分散インデックス・マザーファンド(評価額)	405,524,356
(B)負 債	948,323
未 払 解 約 金	156,037
未 払 信 託 報 酬	769,671
未 払 利 息	1
そ の 他 未 払 費 用	22,614
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	405,589,582
元 本	327,175,803
次 期 繰 越 損 益 金	78,413,779
(D)受 益 権 総 口 数	327,175,803口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D × 10,000)	12,397円

(注) 期首元本額	395,307,345円
期中追加設定元本額	104,208,823円
期中一部解約元本額	172,340,365円

◎損益の状況

当期 (自 '19年 2月 21日 至 '20年 2月 20日)

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	△ 280
支 払 利 息	△ 280
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 4,395,092
売 買 益	5,483,015
売 買 損	△ 9,878,107
(C)信 託 報 酬 等	△ 1,701,608
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 6,096,980
(E)前 期 繰 越 損 益 金	8,802,720
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	75,708,039
(配 当 等 相 当 額)	(44,462,098)
(売 買 損 益 相 当 額)	(31,245,941)
(G) 計 (D + E + F)	78,413,779
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	78,413,779
追 加 信 託 差 損 益 金	75,708,039
(配 当 等 相 当 額)	(44,667,912)
(売 買 損 益 相 当 額)	(31,040,127)
分 配 準 備 積 立 金	30,883,546
繰 越 損 益 金	△ 28,177,806

- (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 4 期 (2019年 2月 21日～ 2020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	2,396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 11 期 運用報告書 (決算日 2020 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 11 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	% 期中 騰落率		% 期中 騰落率			
7期('16年2月22日)	19,898	3.8	20,278	4.1	98.5	0.9	百万円 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
11期('20年2月20日)	25,316	△ 1.3	25,666	△ 1.5	87.0	1.5	5,230

(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		% 騰落率		
(期首) '19年2月20日	25,658	-	26,061	-	97.0	1.3
2月末	25,701	0.2	26,107	0.2	98.3	1.3
3月末	25,717	0.2	26,124	0.2	97.2	2.1
4月末	25,207	△ 1.8	25,586	△ 1.8	97.1	2.2
5月末	24,258	△ 5.5	24,627	△ 5.5	97.1	2.1
6月末	24,288	△ 5.3	24,648	△ 5.4	96.7	2.6
7月末	24,366	△ 5.0	24,722	△ 5.1	98.1	1.4
8月末	24,078	△ 6.2	24,440	△ 6.2	98.0	1.4
9月末	25,147	△ 2.0	25,524	△ 2.1	97.2	2.1
10月末	25,892	0.9	26,268	0.8	97.5	1.9
11月末	26,173	2.0	26,556	1.9	97.6	1.9
12月末	26,313	2.6	26,687	2.4	97.5	1.7
'20年1月末	25,710	0.2	26,071	0.0	97.7	1.5
(期末) '20年2月20日	25,316	△ 1.3	25,666	△ 1.5	87.0	1.5

(注1) 騰落率は期首比です。

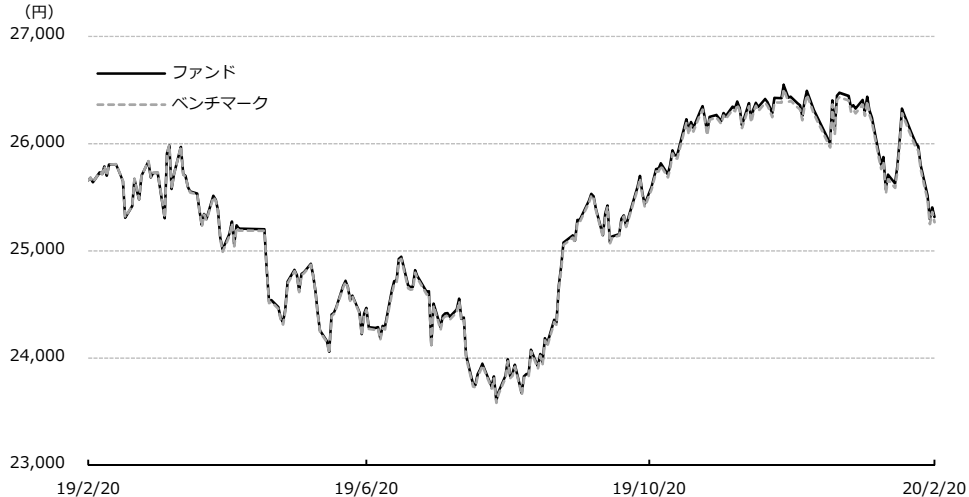
(注2) ベンチマークは、日本株式最小分散インデックスで、ファンド設定日の前営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

当期の運用実績

(2019年2月21日から2020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25,316円となり、前期末の25,658円に比べて342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
 - 米中貿易協議進展への期待
 - 企業業績の改善期待

【マイナスの要因】

- 株式市場の下落
 - 米国による対中追加関税
 - 新型コロナウイルス感染拡大による経済への影響に対する懸念

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は-1.3%となり、ベンチマークの騰落率(-1.5%)を0.2%上回りましたが、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。

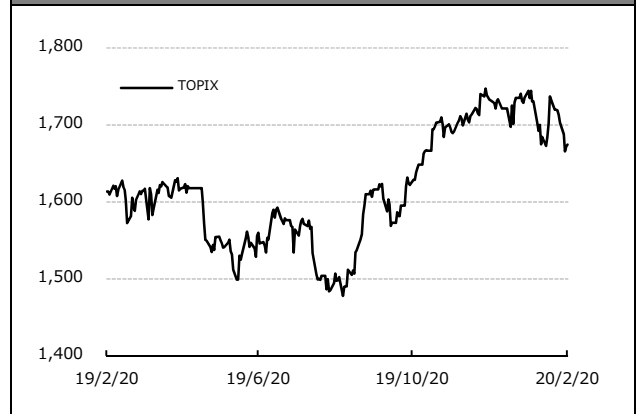
投資環境

(2019年2月21日から2020年2月20日まで)

国内株式市場

当期の株式市場は、欧米の利下げ観測が相場を支える中、米中貿易問題の動向を巡って一喜一憂する展開で始まりました。8月、トランプ米大統領が中国への追加関税第4弾を示唆したことから大幅下落となりましたが、9月に入り米中通商協議再開が報じられると反発しました。その後も10月中旬の米中通商協議の部分合意を受けて貿易摩擦への懸念が後退したことや、米株高、円安ドル高傾向、企業業績の改善期待などを背景に上昇基調となりました。しかし、1月下旬以降は新型コロナウイルス感染拡大による経済への影響に対する懸念が強まったことや低調な企業業績、国内GDPの悪化などを受けて軟調な展開で期末を迎えました。

国内株式指数の推移



運用の概況

(2019年2月21日から2020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 (2019年2月21日~2020年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	25,237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)	9円 (9) (0)	0.037% (0.036) (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	9円	0.038%	

(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('19年2月21日から'20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
		781	1,483,267	2,369	4,046,649
		(27)	(-)		

(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 650	百万円 676	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	5,529,917 千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	6,295,976 千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.87

(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('19年2月21日から'20年2月20日まで)

○株 式

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
ソフトバンク	86	127,125	1,471	オリエンタルランド	7	105,363	14,633
東京瓦斯	40	120,284	3,007	KDDI	31	93,549	2,951
ANAホールディングス	30	114,877	3,741	国際石油開発帝石	92	91,378	986
積水ハウス	58	110,589	1,906	武田薬品工業	19	87,891	4,438
ヤマダ電機	182	95,401	522	中国電力	60	83,919	1,394
ディー・エヌ・エー	48	91,112	1,874	NTTドコモ	29	80,969	2,782
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	20	71,862	3,593	すかいらーくホールディングス	38	74,708	1,930
近鉄グループホールディングス	11	68,983	5,796	セブン&アイ・ホールディングス	16	68,215	4,109
ゆうちょ銀行	52	65,330	1,234	日産自動車	98	65,208	663
神戸物産	13	53,212	3,971	ヤマダ電機	109	58,007	531

(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('19年2月21日から'20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('20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		千円		千株	千株		千円
水産・農林業(1.0%)					日新製糖	0.5	0.5		1,004
極洋	1	0.8		2,240	中村屋	0.3	0.1		401
マルハニチロ	15	9		23,854	江崎グリコ	-	4		20,253
サカタのタネ	5	3		11,339	名糖産業	0.4	0.4		556
ホクト	6	3		5,922	不二家	1	0.8		1,852
ホクリヨウ	1	-		-	モロゾフ	0.1	0.1		492
鉱業(-%)					ヤクルト本社	2	-		-
国際石油開発帝石	92	-		-	明治ホールディングス	12	7		55,146
建設業(4.6%)					日本ハム	0.3	0.2		932
ショーボンドホールディングス	1	2		8,470	丸大食品	2	1		2,401
タマホーム	1	-		-	S Foods	4	-		-
サンヨーホームズ	0.6	-		-	柿安本店	-	2		9,004
コムシスホールディングス	19	12		35,319	伊藤ハム米久ホールディングス	19	12		8,076
ヤマウラ	1	0.8		751	アサヒグループホールディングス	3	2		13,507
大成建設	10	-		-	キリンホールディングス	17	11		25,611
不動テトラ	7	-		-	オエノンホールディングス	6	2		1,125
西松建設	12	-		-	養命酒製造	0.4	0.2		386
三井住友建設	39	-		-	サントリー食品インターナショナル	24	15		72,618
佐田建設	1	-		-	ダイドーグループホールディングス	4	1		6,296
熊谷組	3	2		7,337	伊藤園	9	5		31,726
植木組	0.2	-		-	キーコーヒー	3	2		5,625
大東建託	2	1		21,114	ユニカフェ	0.6	-		-
積水ハウス	-	40		92,931	ジャパンフーズ	0.5	-		-
四電工	0.3	0.2		516	日清オイリオグループ	3	2		7,420
きんでん	17	3		5,737	不二製油グループ本社	3	2		6,595
協和エクシオ	20	13		34,439	J-オイルミルズ	1	0.7		2,975
大気社	3	-		-	味の素	49	31		62,789
東芝プラントシステム	10	-		-	キューピー	16	10		21,735
東洋エンジニアリング	1	-		-	ハウス食品グループ本社	11	7		25,456
レイズネクスト	3	2		3,086	カゴメ	13	7		19,447
食料品(13.4%)					焼津水産化学工業	1	0.4		404
日東富士製粉	0.1	0.1		622	アリアケジャパン	0.8	0.5		3,750
昭和産業	1	1		3,035	ピエトロ	0.4	-		-
鳥越製粉	1	0.7		578	エバラ食品工業	0.4	0.3		654
東洋精糖	0.7	-		-	ニチレイ	11	7		20,683
三井製糖	3	2		4,164	東洋水産	-	3		15,942
塩水港精糖	4	-		-	イートアンド	1	0.7		1,287

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大冷	0.6	-	-
日清食品ホールディングス	13	7	62,300
永谷園ホールディングス	0.8	0.1	212
フジッコ	2	1	2,826
ロック・フィールド	3	1	2,692
日本たばこ産業	54	37	84,105
わらべや日洋ホールディングス	2	-	-
なとり	1	0.5	847
理研ビタミン	0.5	0.4	1,586
繊維製品(0.0%)			
シキボウ	1	1	1,260
トーア紡コーポレーション	1	-	-
ダイドーリミテッド	5	-	-
東レ	15	-	-
日本フェルト	0.6	-	-
イチカワ	0.2	-	-
日東製網	0.2	-	-
アツギ	2	-	-
ソトー	0.7	-	-
東海染工	0.2	-	-
オンワードホールディングス	8	-	-
キング	1	-	-
ヤマトインターナショナル	1	-	-
パルプ・紙(0.7%)			
日本製紙	27	17	29,601
化学(2.4%)			
日東エフシー	1	-	-
花王	17	10	88,660
ニイタカ	0.1	-	-
ライオン	4	2	5,597
コタ	0.4	0.4	591
シーボン	0.2	-	-
アジバンコスメジャパン	1	-	-
日本高純度化学	0.2	0.2	532
アース製薬	3	1	8,484
大成ロミック	0.4	0.2	560
前澤化成工業	0.4	-	-
エフピコ	1	0.7	4,823
医薬品(1.1%)			
武田薬品工業	22	3	12,905
アステラス製薬	24	-	-

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
田辺三菱製薬	5	-	-
ビオフェルミン製薬	0.1	-	-
小野薬品工業	0.1	-	-
持田製薬	1	-	-
参天製薬	20	-	-
扶桑薬品工業	0.3	-	-
ツムラ	14	-	-
キッセイ薬品工業	0.9	-	-
日水製薬	1	0.7	923
沢井製薬	7	5	35,200
大幸薬品	1	0.5	2,615
大塚ホールディングス	2	-	-
石油・石炭製品(0.0%)			
ビーピー・カストロール	1	0.7	960
ゴム製品(0.6%)			
ブリヂストン	11	7	28,677
住友ゴム工業	0.9	-	-
ガラス・土石製品(0.6%)			
住友大阪セメント	14	6	27,939
鉄鋼(0.4%)			
丸一鋼管	12	7	20,013
非鉄金属(0.4%)			
カナレ電気	0.4	-	-
アサヒホールディングス	2	6	17,299
金属製品(0.3%)			
稲葉製作所	2	0.7	933
アルインコ	1	0.3	327
長府製作所	1	-	-
リンナイ	2	1	13,889
ダイニチ工業	0.9	-	-
三洋工業	0.4	-	-
岡部	2	-	-
中国工業	0.3	-	-
モリテック スチール	7	-	-
機械(2.2%)			
日本ドライケミカル	1	-	-
フリュー	1	1	1,621
オイレス工業	0.9	-	-
日工	0.3	7	6,130
巴工業	1	0.6	1,275
荏原実業	0.4	-	-

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
平和	26	9	21,375
SANKYO	20	9	36,613
マースグループホールディングス	1	0.8	1,593
ダイコク電機	1	0.2	276
セガサミーホールディングス	27	17	29,050
前澤給装工業	0.4	0.3	659
電気機器(4.7%)			
日本電産	1	-	-
不二電機工業	0.3	-	-
テクノメディカ	0.4	0.3	616
日本電気	27	17	82,953
岩崎通信機	0.9	-	-
電気興業	0.4	-	-
ナカヨ	0.3	-	-
アイホン	1	0.6	1,005
アイコム	1	0.4	1,031
アズビル	15	9	28,782
日本光電工業	12	8	28,080
共和電業	0.8	0.8	346
小野測器	0.5	-	-
コーセル	1	-	-
キヤノン電子	2	1	2,635
キヤノン	37	24	67,178
MUTOHホールディングス	0.3	-	-
輸送用機器(0.8%)			
日産自動車	98	-	-
レシップホールディングス	1	-	-
シマノ	3	2	34,210
精密機器(0.1%)			
クリエートメディック	0.3	-	-
JMS	0.4	-	-
リズム時計工業	0.3	-	-
大研医器	4	-	-
メニコン	-	0.4	2,012
シンシア	0.6	-	-
松風	0.8	0.6	1,175
その他製品(1.0%)			
スノーピーク	0.4	0.4	340
パラマウントベッドホールディングス	1	1	4,570
粧美堂	0.7	-	-
永大産業	1	-	-

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
バンダイナムコホールディングス	9	6	35,460
共立印刷	5	-	-
フランスベッドホールディングス	3	1	1,558
エステールホールディングス	0.3	-	-
光村印刷	0.1	-	-
TAKARA & COMPANY	1	0.7	1,158
ツツミ	0.5	0.4	789
小松ウオール工業	0.5	-	-
キングジム	4	1	1,092
任天堂	1	-	-
コクヨ	11	-	-
美津濃	1	-	-
電気・ガス業(6.1%)			
中国電力	99	55	81,144
北陸電力	33	-	-
東北電力	32	17	17,969
九州電力	73	56	48,535
沖縄電力	5	3	7,031
電源開発	17	10	27,280
東京瓦斯	-	25	61,378
大阪瓦斯	16	10	18,937
東邦瓦斯	4	2	11,861
北海道瓦斯	1	1	1,600
広島ガス	4	0.9	305
陸運業(4.8%)			
京王電鉄	4	2	16,352
富士急行	2	2	9,802
新京成電鉄	0.5	0.3	717
東日本旅客鉄道	0.8	0.5	4,507
西日本旅客鉄道	9	6	52,392
東海旅客鉄道	1	0.6	12,435
近鉄グループホールディングス	-	8	45,496
阪急阪神ホールディングス	7	4	17,622
南海電気鉄道	10	6	18,319
京阪ホールディングス	4	3	14,265
神戸電鉄	1	0.7	2,768
名古屋鉄道	11	7	21,455
山陽電気鉄道	3	1	3,372
丸運	0.6	-	-
丸全昭和運輸	0.6	-	-
日本石油輸送	0.2	-	-

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
神奈川中央交通 空運業(2.6%)	0.7	0.3	1,177
日本航空	13	14	43,778
A N Aホールディングス 倉庫・運輸関連業(0.0%)	-	22	73,292
澁澤倉庫	0.5	0.3	621
東陽倉庫	1	1	372
中央倉庫	0.2	0.2	226
東洋埠頭	0.2	-	-
キムラユニティー	0.9	-	-
エーアイティー	0.7	0.7	672
情報・通信業(13.9%)			
N E Cネットエスアイ	4	2	10,972
電算システム	0.5	-	-
グリー	17	11	5,118
電算	0.1	-	-
オブティム	-	1	8,835
ティーガイア	3	1	4,396
ザッパラス	2	-	-
朝日ネット	1	-	-
ハイマックス	0.3	-	-
野村総合研究所	3	-	-
東邦システムサイエンス	1	-	-
フジ・メディア・ホールディングス	22	-	-
Zホールディングス	222	140	59,516
トレンドマイクロ	2	1	8,246
日本オラクル	6	4	42,064
C A C Holdings	1	-	-
東計電算	0.4	0.1	453
エックスネット	1	-	-
大塚商会	12	-	-
C I J	2	1	1,399
ビジネスエンジニアリング	0.3	-	-
WOWOW	1	0.7	1,864
マーベラス	7	4	2,956
日本テレビホールディングス	4	2	3,790
朝日放送グループホールディングス	2	0.9	648
スカパーJ S A Tホールディングス	29	18	8,817
日本BS放送	1	-	-
クロップス	0.3	-	-
日本電信電話	27	34	94,384

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
K D D I	50	28	98,179
ソフトバンク	-	64	95,750
N T T ドコモ	57	30	96,434
アイトマーケティングコミュニケーション	4	-	-
昭文社	0.5	-	-
松竹	1	1	15,257
東宝	-	3	12,384
東映	-	0.4	5,584
ピー・シー・エー	0.4	0.3	1,236
スクウェア・エニックス・ホールディングス	-	6	30,256
カブコン	-	4	16,929
N S D	-	3	6,250
卸売業(5.3%)			
伊藤忠食品	0.4	0.2	974
フィールズ	7	-	-
横浜冷凍	12	5	4,966
神戸物産	-	12	54,858
バイタルケースケーホールディングス	10	3	4,083
八洲電機	1	0.7	618
レスターホールディングス	0.9	-	-
大光	1	-	-
T O K A Iホールディングス	18	9	8,972
デリカフーズホールディングス	0.9	-	-
コマダホールディングス	16	10	21,838
富士興産	1	-	-
エコートレーディング	0.4	-	-
中山福	0.9	-	-
三菱食品	1	0.9	2,638
メディパルホールディングス	6	4	8,820
S P K	0.4	0.2	524
アズワン	-	0.6	5,442
尾家産業	0.3	-	-
シモジマ	0.3	0.3	331
ドウシシャ	3	1	2,508
小津産業	0.4	-	-
高速	0.4	0.2	240
たけびし	0.4	0.2	287
橋本総業ホールディングス	0.2	-	-
タカショー	1	-	-
蝶理	0.6	-	-
三共生興	0.9	0.9	494

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ツカモトコーポレーション	0.4	-	-
東都水産	0.6	-	-
OUGホールディングス	0.5	-	-
スターゼン	1	0.5	2,202
内田洋行	0.4	-	-
キヤノンマーケティングジャパン	5	3	8,466
岩谷産業	-	4	17,885
G S Iクレオス	1	-	-
東邦ホールディングス	2	1	3,587
サンゲツ	7	4	7,180
シナネンホールディングス	0.5	0.3	646
伊藤忠エネクス	7	4	4,140
サンリオ	18	8	16,916
トーヨー	0.5	-	-
東陽テクニカ	2	1	1,557
モスフードサービス	10	6	20,318
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.4	-	-
トラスコ中山	9	5	13,434
オートバックスセブン	20	9	13,851
加藤産業	1	-	-
イエローハット	2	2	4,277
因幡電機産業	2	-	-
タキヒヨー	0.6	0.3	547
蔵王産業	0.7	-	-
スズケン	3	2	10,012
小売業(14.3%)			
ローソン	5	3	21,148
エービーシー・マート	13	6	41,974
アスクル	8	-	-
ジーフット	1	-	-
くら寿司	7	-	-
キャンドウ	1	0.8	1,304
フジオフードシステム	-	3	5,487
あみやき亭	0.3	0.3	1,024
大黒天物産	0.1	-	-
ハニーズホールディングス	0.5	0.5	671
アルペン	4	2	4,370
DCMホールディングス	36	14	15,346
きちりホールディングス	0.5	-	-
ドトール・日レスホールディングス	6	3	6,255
丸善CHIホールディングス	4	-	-

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エー・ピーカンパニー	0.6	-	-
チムニー	1	0.7	1,557
シュッピン	-	0.6	587
ホットランド	3	2	2,971
すかいらーくホールディングス	81	43	80,049
SFPホールディングス	-	0.6	1,279
コナドットスーパーマーケットホールディングス	1	-	-
あさひ	6	3	4,807
コスモス薬品	0.3	-	-
セブン&アイホールディングス	17	1	5,096
フェリシモ	0.3	-	-
スシローグローバルホールディングス	10	7	66,000
はるやまホールディングス	0.3	-	-
カップ・クリエイト	9	3	5,357
ライトオン	3	-	-
三城ホールディングス	1	-	-
ハウス オブ ローゼ	0.3	-	-
イオン北海道	1	1	997
ヒマラヤ	0.6	-	-
ワタミ	2	1	1,767
マルシェ	1	-	-
西松屋チェーン	11	7	6,795
ゼンショーホールディングス	22	13	32,006
ハークスレイ	0.4	-	-
サイゼリヤ	5	3	7,530
魚力	1	-	-
ポプラ	0.4	-	-
フジ・コーポレーション	0.9	0.7	1,407
京都きもの友禅	2	-	-
コロワイド	10	6	14,326
壱番屋	2	1	7,602
トップカルチャー	1	-	-
スギホールディングス	4	2	14,661
ヴィア・ホールディングス	5	-	-
木曽路	5	2	6,263
SRSホールディングス	6	6	6,331
ケーヨー	3	2	1,365
ロイヤルホールディングス	8	3	7,235
島忠	3	2	7,212
チヨダ	2	1	2,334
リンガーハット	4	2	6,498

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
デンアライド	2	-	-
コメリ	5	-	-
しまむら	1	1	9,264
はせがわ	1	-	-
ブックオフグループホールディングス	1	1	1,111
ヤマダ電機	90	164	97,475
ニトリホールディングス	6	4	69,552
グルメ杵屋	3	1	1,741
吉野家ホールディングス	25	21	53,867
松屋フーズホールディングス	1	0.9	4,014
サガミホールディングス	4	3	5,027
王将フードサービス	2	1	9,002
ブレナス	6	2	4,053
ミニストップ	3	2	3,044
藤久	0.5	-	-
大庄	1	0.6	975
ヤマザワ	0.3	-	-
銀行業(4.5%)			
島根銀行	0.5	-	-
ゆうちょ銀行	67	77	78,019
あおぞら銀行	20	12	38,784
みちのく銀行	2	1	1,333
鳥取銀行	0.6	-	-
みずほフィナンシャルグループ	832	544	86,348
長野銀行	0.6	0.4	586
中京銀行	2	0.8	1,761
トマト銀行	0.2	-	-
証券・商品先物取引業(-%)			
丸三証券	9	-	-
保険業(1.3%)			
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	-	14	54,574
東京海上ホールディングス	-	0.9	5,513
アドバンスクリエイト	1	-	-
不動産業(0.2%)			
日本駐車場開発	63	37	5,416
パーク24	5	-	-
東京楽天地	0.3	0.3	1,677
フジ住宅	3	2	1,381
A V A N T I A	1	0.9	855
ファースト住建	0.8	0.6	748
穴吹興産	0.2	-	-

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ランドビジネス	1	-	-
サービス業(12.7%)			
中広	0.8	-	-
エスクリ	1	-	-
アイ・ケイ・ケイ	2	-	-
スタジオアリス	2	1	3,295
N J S	0.3	-	-
カカクコム	-	0.1	285
ルネサンス	3	1	2,878
ディップ	-	2	6,804
ツカダ・グローバルホールディング	7	-	-
プラス	0.9	-	-
ディー・エヌ・エー	-	42	66,380
ティア	0.7	-	-
C D G	0.6	-	-
J Pホールディングス	11	5	1,699
T A C	2	-	-
ケネディクス	30	18	12,700
ぴあ	0.4	0.2	777
みらかホールディングス	2	-	-
ダイオース	0.2	-	-
オリエンタルランド	12	6	86,908
ダスキン	4	2	8,097
明光ネットワークジャパン	8	3	2,748
ファルコホールディングス	0.3	-	-
リゾートトラスト	18	11	19,033
リソー教育	37	28	10,696
早稲田アカデミー	0.5	-	-
ユー・エス・エス	26	17	32,028
テー・オー・ダブリュー	2	1	1,374
セントラルスポーツ	2	1	3,273
リソルホールディングス	0.4	-	-
アイ・アールジャパンホールディングス	-	3	28,743
キャリアリンク	0.7	-	-
I B J	-	10	12,576
アサンテ	1	0.9	1,687
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.4	0.4	666
日本ビューホテル	1	-	-
日本郵政	111	71	72,159
一蔵	0.9	-	-
L I T A L I C O	-	2	5,199

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キュービーネットホールディングス	3	2	5,700
東祥	3	2	4,351
エイチ・アイ・エス	15	9	24,353
共立メンテナンス	11	7	29,088
燦ホールドディングス	0.3	0.4	625
東京テアトル	2	0.8	1,052
タナベ経営	0.4	-	-
よみうりランド	1	0.4	1,638
東京都競馬	2	1	5,512
常磐興産	1	0.4	648
東京ドーム	16	24	23,401
藤田観光	1	1	2,713
白洋舎	0.3	-	-

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セコム	10	6	64,594
進学会ホールディングス	1	-	-
オオバ	2	1	856
学究社	1	-	-
ベネッセホールディングス	18	11	33,948
ステップ	1	0.5	824
合計	株数・金額 4,159	2,598	4,552,663
	銘柄数 < 比率 > 443	288	<87.0%>

(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 67	百万円 -
	ミ ニ ト オ P I X	11	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎投資信託財産の構成('20年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 4,552,663	% 87.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	679,846	13.0
投 資 信 託 財 産 総 額	5,232,509	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

('20年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	5,232,360,844
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	102,669,758
株 式 (評 価 額)	4,552,663,270
未 収 入 金	556,557,216
未 収 配 当 金	14,082,800
差 入 委 託 証 拠 金	6,387,800
(B)負 債	1,918,747
未 払 金	1,915,840
未 払 利 息	148
そ の 他 未 払 費 用	2,759
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	5,230,442,097
元 本	2,066,041,811
次 期 繰 越 損 益 金	3,164,400,286
(D)受 益 権 総 口 数	2,066,041,811口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D × 10,000)	25,316円

(注1) 期首元本額 2,973,329,587円
期中追加設定元本額 40,364,165円
期中一部解約元本額 947,651,941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) 1,905,856,807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 160,185,004円

◎損益の状況

当期(自'19年2月21日 至'20年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	165,536,865
受 取 配 当 金	165,116,495
受 取 利 息	56
そ の 他 収 益 金	483,473
支 払 利 息	△ 63,159
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 283,135,684
売 買 益	431,347,884
売 買 損	△ 714,483,568
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	7,390,789
取 引 益	15,231,236
取 引 損	△ 7,840,447
(D)そ の 他 費 用	△ 61,444
(E)当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	△ 110,269,474
(F)前 期 繰 越 損 益 金	4,655,537,484
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	62,141,335
(H)解 約 差 損 益 金	△ 1,443,009,059
(I) 計 (E + F + G + H)	3,164,400,286
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	3,164,400,286

(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。