

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 | 信託期間は2017年6月27日から無期限です。 | |
| 運用方針 | 投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 | |
| 主要運用対象 | SMT JPX日経中小型株インデックス・オープン | 下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | JPX日経中小型株インデックスマザーファンド | わが国の金融商品取引所等に上場されている株式を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | SMT JPX日経中小型株インデックス・オープン | 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。 |
| | JPX日経中小型株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は行いません。 |
| 分配方針 | 年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 | |

SMT JPX日経中小型株インデックス・オープン

運用報告書(全体版)

第16期(決算日 2025年4月21日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容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:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時~午後5時です。)

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額 |
|-------------------|-------------|--------|----------|--------|----------|-----------|------------|
| | (分配落) | 税込分配金 | 期中騰落率 | | | | |
| 第12期(2023年4月20日) | 円 13,256 | 円 0 | % 4.8 | 13,626 | % 5.1 | % 97.8 | % 1.9 |
| 第13期(2023年10月20日) | 13,624 | 0 | 2.8 | 13,952 | 2.4 | 97.4 | 1.8 |
| 第14期(2024年4月22日) | 16,223 | 0 | 19.1 | 16,656 | 19.4 | 98.4 | 1.2 |
| 第15期(2024年10月21日) | 16,796 | 0 | 3.5 | 17,320 | 4.0 | 98.3 | 1.2 |
| 第16期(2025年4月21日) | 16,072 | 0 | △4.3 | 16,617 | △4.1 | 97.8 | 1.2 |
| | | | | | | | 百万円 108 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は「貢建比率－売建比率」です。

当期中の基準価額と市況の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | 株式組入比率 | 株式先物比率 |
|----------------------|-------------|--------|--------|--------|-----------|
| | | 騰落率 | | | |
| (当期首) 2024年10月21日 | 円 16,796 | % — | 17,320 | % — | % 98.3 |
| 10月末 | 16,702 | △0.6 | 17,221 | △0.6 | 98.4 |
| 11月末 | 16,993 | 1.2 | 17,539 | 1.3 | 98.0 |
| 12月末 | 17,425 | 3.7 | 17,987 | 3.8 | 98.1 |
| 2025年1月末 | 17,360 | 3.4 | 17,909 | 3.4 | 98.1 |
| 2月末 | 16,473 | △1.9 | 17,009 | △1.8 | 98.2 |
| 3月末 | 16,477 | △1.9 | 17,016 | △1.8 | 97.8 |
| (当期末) 2025年4月21日 | 16,072 | △4.3 | 16,617 | △4.1 | 97.8 |
| | | | | | 1.2 |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は「貢建比率－売建比率」です。

ベンチマークは、JPX日経中小型株指数（配当込み）です。

JPX日経中小型株指数は、東京証券取引所のプライム市場、スタンダード市場、グロース市場を主市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社JPX総研及び株式会社日本経済新聞社が選定した、原則200銘柄で構成される株価指数です。起算日は2016年8月31日・基準値は10000ポイントです。

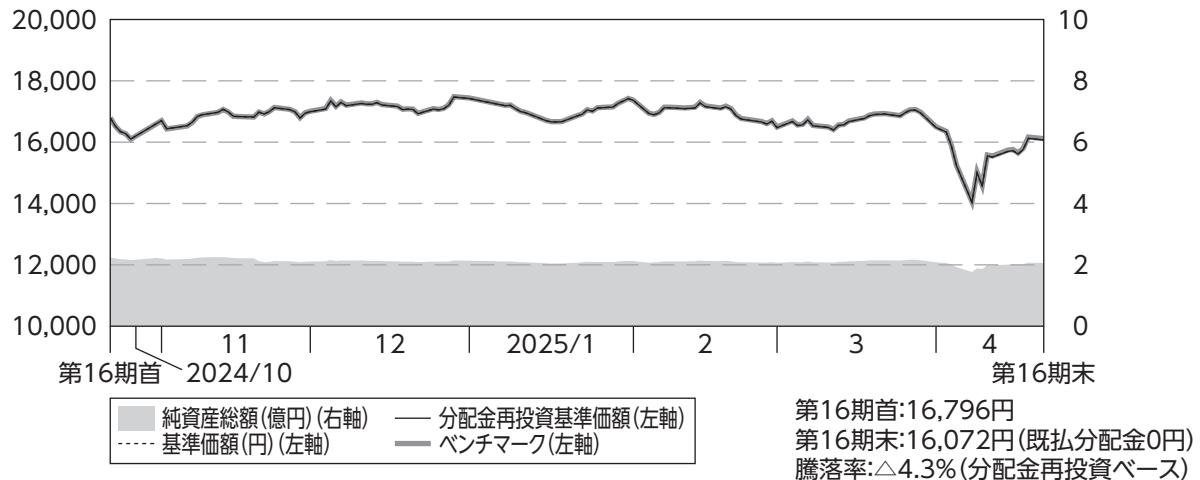
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

【同指数】は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）及び株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」という。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPX及び日経は、同指数自体及び同指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

JPX及び日経は、同指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。当ファンドは、当社の責任のもとで運用されるものであり、JPX及び日経は、その運用及び当ファンドの取引に関する、一切の責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注1)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ものとみな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すものです。

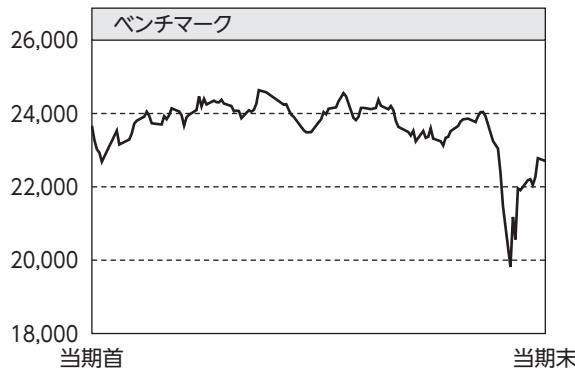
(注2)分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3)分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2024年10月21日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるJPX日経中小型株指数(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、期末は期首比で下落しました。

投資環境



当期の国内株式市場は下落しました。

期初、トランプ氏の米大統領再選を受け反発した後、米国の中国への半導体輸出規制強化に対する懸念や、地政学リスクの高まり、日銀の利上げ観測などが重石となり、軟調に推移しました。その後公的年金の運用目標利回り引き上げ報道を受け上昇しましたが、FRB(米連邦準備理事会)の利下げへの慎重姿勢から長期金利が上昇し、一進一退の展開となりました。米国でAI(人工知能)への巨額投資計画が発表され、国内半導体株にも買いが波及する場面もありましたが、期末にかけては、米国の関税政策強化による世界景気の先行き不透明感や円高・米ドル安の進行などから、国内株式市場は大幅に下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

株式への投資は「JPX日経中小型株インデックスマザーファンド」の組み入れにより行いました。

【「JPX日経中小型株インデックスマザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるJPX日経中小型株指数(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 株式組入比率

先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。

なお、ヘッジ目的で、株価指数先物取引(TOPIX先物)を適宜活用しています。

(2) ポートフォリオ構成

現物株式については、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。

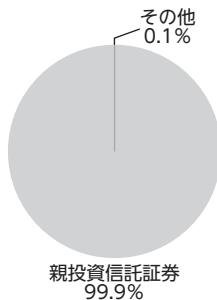
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

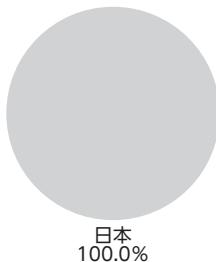
| | 当期末 |
|------------------------|------------|
| | 2025年4月21日 |
| JPX日経中小型株インデックスマザーファンド | 99.9% |
| その他 | 0.1% |
| 組入ファンド数 | 1 |

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

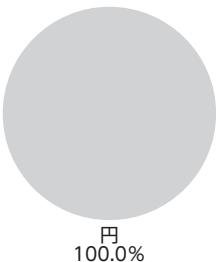
○資産別配分



○国別配分



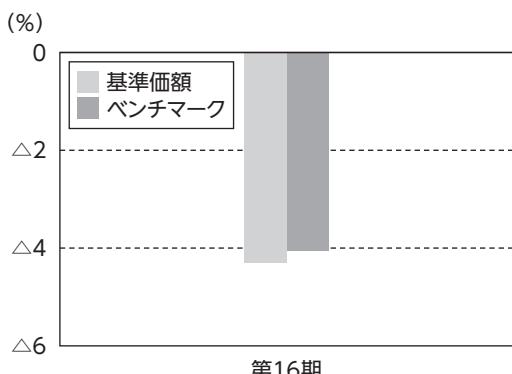
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。
差異の主な要因は信託報酬(マイナス)によるものです。

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきました。

なお、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いて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

| 項目 | 第16期 | |
|------------------|------------------------|--|
| | 2024年10月22日～2025年4月21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 (円) | 6,906 | |

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の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3)ー印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

JPX日経中小型株インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資し、JPX日経中小型株指数(配当込み)に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 | |
|------------------|--------------------------|---------|---|--|
| | (2024年10月22日~2025年4月21日) | | | |
| | 金額 | 比率 | | |
| (a) 信託報酬 | 37円 | 0.219% | (a)信託報酬=[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は16,905円です。 信託報酬に係る消費税は(当作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 | |
| (投信会社) | (17) | (0.099) | | |
| (販売会社) | (17) | (0.099) | | |
| (受託会社) | (4) | (0.022) | | |
| (b) 売買委託手数料 | 2 | 0.014 | (b)売買委託手数料=[期中の売買委託手数料]×10,000 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 | |
| (株式) | (2) | (0.013) | | |
| (新株予約権証券) | (-) | (-) | | |
| (オプション証券等) | (-) | (-) | | |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (-) | (-) | | |
| (投資信託証券) | (-) | (-) | | |
| (商品) | (-) | (-) | | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | | |
| (c) 有価証券取引税 | - | - | (c)有価証券取引税=[期中の有価証券取引税]×10,000 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 | |
| (株式) | (-) | (-) | | |
| (新株予約権証券) | (-) | (-) | | |
| (オプション証券等) | (-) | (-) | | |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (-) | (-) | | |
| (公社債) | (-) | (-) | | |
| (投資信託証券) | (-) | (-) | | |
| (d) その他費用 | 0 | 0.003 | (d)その他費用=[期中のその他費用]×10,000 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保 管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用 | |
| (保管費用) | (-) | (-) | | |
| (監査費用) | (0) | (0.003) | | |
| (その他) | (-) | (-) | | |
| 合計 | 39 | 0.236 | | |

(注1)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た結果です。
なわ、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、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。

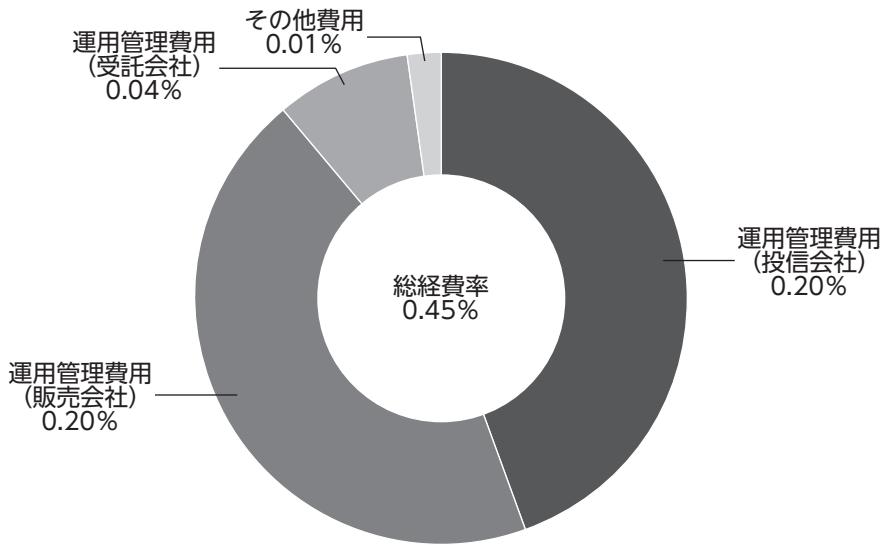
(注2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3)「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。

<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0.45%です。



(注1)各費用は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)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

＜親投資信託受益証券の設定、解約状況＞

| | 当期 | | | |
|----------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | 設定 | | 解約 | |
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| JPX日経中小型株インデックス マザーファンド | 千口 12,717 | 千円 21,627 | 千口 18,011 | 千円 31,259 |

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

＜JPX日経中小型株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 | 62,219千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 208,015千円 |
| (c) 売買高比率(a) / (b) | 0.29 |

(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) (c) 売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

| 区分 | 当期 | | | | | |
|---------|-----------------|-----------------|---------------|-----------------|-----------------|---------------|
| | 買付額等A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 金銭信託 | 百万円 0.000320 | 百万円 0.000320 | % 100.0 | 百万円 0.000320 | 百万円 0.000320 | % 100.0 |
| コール・ローン | 83 | 13 | 15.7 | 83 | 13 | 15.7 |

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

＜JPX日経中小型株インデックスマザーファンド＞

| 区分 | 当期 | | | | | |
|---------|-----------------|-----------------|---------------|-----------------|-----------------|---------------|
| | 買付額等A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 金銭信託 | 百万円 0.002984 | 百万円 0.002984 | % 100.0 | 百万円 0.002984 | 百万円 0.002984 | % 100.0 |
| コール・ローン | 404 | 67 | 16.6 | 404 | 67 | 16.6 |

〈平均保有割合 100.0%〉

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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

＜親投資信託残高＞

| 種 類 | 当期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------------|----------|----------|-------------|-------------|
| | 口 数 | 千口 | 口 数 | 評 価 額 |
| JPX日経中小型株インデックスマザーファンド | 129, 359 | 129, 359 | 124, 065 | 206, 246 |

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、124, 065千口です。

投資信託財産の構成

| 項 目 | 当 期 末 | |
|------------------------|----------------|------------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| JPX日経中小型株インデックスマザーファンド | 千円 206, 246 | % 99. 7 |
| コール・ローン等、その他 | 585 | 0. 3 |
| 投資信託財産総額 | 206, 831 | 100. 0 |

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項目 | 当期末 2025年4月21日現在 |
|---------------------------------|---------------------|
| (A) 資産 | 206,831,374円 |
| コール・ローン等 | 585,121 |
| JPX日経中小型株インデックス マザーファンド(評価額) | 206,246,246 |
| 未 収 利 息 | 7 |
| (B) 負債 | 481,605 |
| 未 払 解 約 金 | 12,793 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 463,086 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 5,726 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 206,349,769 |
| 元 本 | 128,394,252 |
| 次期繰越損益金 | 77,955,517 |
| (D) 受益権総口数 | 128,394,252口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 16,072円 |

■損益の状況

| 項目 | 当期 自 2024年10月22日 至 2025年 4月21日 |
|--------------------------------------|---|
| (A)配当等収益 受取利息 | 1,012円 1,012 |
| (B)有価証券売買損益 売買益 売買損 | △8,493,798 454,964 △8,948,762 |
| (C)信託報酬等 | △468,812 |
| (D)当期損益金(A+B+C) | △8,961,598 |
| (E)前期繰越損益金 | 19,636,366 |
| (F)追加信託差損益金 (配当等相当額) (売買損益相当額) | 67,280,749 (65,764,816) (1,515,933) |
| (G)計(D+E+F) | 77,955,517 |
| (H)収益分配金 次期繰越損益金(G+H) | 0 77,955,517 |
| 追加信託差損益金 (配当等相当額) (売買損益相当額) | 67,280,749 (65,859,262) (1,421,487) |
| 分配準備積立金 | 22,817,228 |
| 繰越損益金 | △12,142,460 |

(注1) (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。

(注2) (C)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。

(注3) (F)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。

〈注記事項〉

※当ファンの期首元本額は133,588,214円、期中追加設定元本額は21,773,114円、期中一部解約元本額は26,967,076円です。

※分配金の計算過程

| 項目 | 当期 |
|--------------------------------|--------------|
| (A)配当等収益額(費用控除後) | 3,180,862円 |
| (B)有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後) | 一円 |
| (C)収益調整金額 | 65,859,262円 |
| (D)分配準備積立金額 | 19,636,366円 |
| (E)分配対象収益額(A+B+C+D) | 88,676,490円 |
| (F)期末残存口数 | 128,394,252口 |
| (G)収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000) | 6,906円 |
| (H)分配金額(1万口当たり) | 一円 |
| (I)収益分配金額(F×H/10,000) | 一円 |

お知らせ

「投資信託及び投資法人に関する法律」第14条の改正に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2025年4月1日)

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。

本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。

今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。

JPX日経中小型株インデックスマザーファンド

運用報告書

第8期（決算日 2024年10月21日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 信託期間 | 信託期間は2017年6月27日から無期限です。 |
| 運用方針 | 投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要運用対象 | わが国の金融商品取引所等に上場されている株式を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | 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。 |

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額 |
|------------------|-------------|----------|--------|----------|--------|--------|-----------|
| | | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | |
| 第4期(2020年10月20日) | 円 11,510 | % 6.2 | 11,580 | % 5.7 | 97.9 | 1.8 | 百万円 91 |
| 第5期(2021年10月20日) | 13,990 | 21.5 | 13,987 | 20.8 | 97.6 | 2.0 | 101 |
| 第6期(2022年10月20日) | 12,940 | △7.5 | 12,966 | △7.3 | 97.4 | 1.8 | 106 |
| 第7期(2023年10月20日) | 14,001 | 8.2 | 13,952 | 7.6 | 97.5 | 1.8 | 127 |
| 第8期(2024年10月21日) | 17,336 | 23.8 | 17,320 | 24.1 | 98.3 | 1.2 | 224 |

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」です。

ベンチマークは、JPX日経中小型株指数（配当込み）です。

JPX日経中小型株指数は、東京証券取引所のプライム市場、スタンダード市場、グロース市場を主市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社JPX総研及び株式会社日本経済新聞社が選定した、原則200銘柄で構成される株価指数です。起算日は2016年8月31日・基準値は10000ポイントです。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

【同指数】は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）及び株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」という。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPX及び日経は、同指数自体及び同指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

JPX及び日経は、同指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。当ファンドは、当社の責任のもとで運用されるものであり、JPX及び日経は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の基準価額と市況の推移

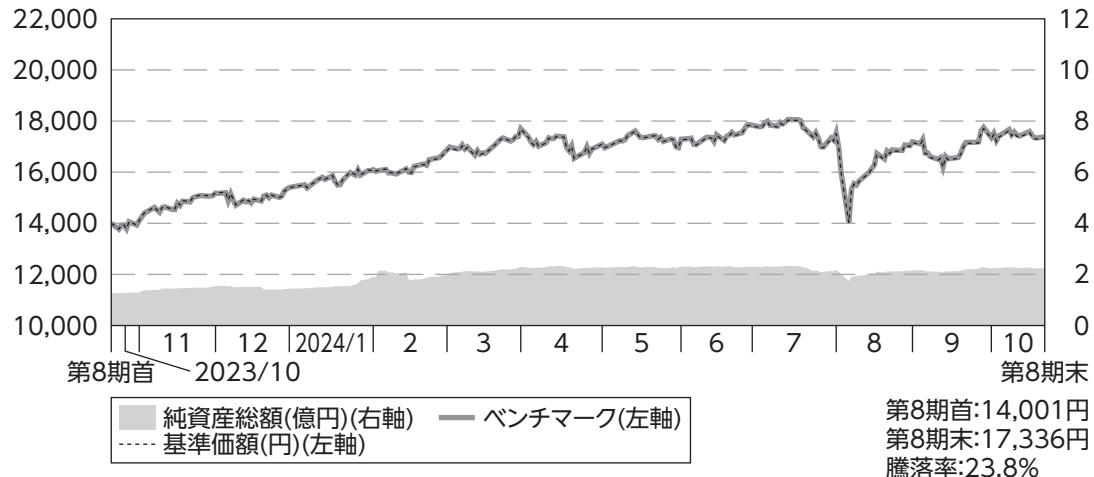
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | ベンチマーク | | 株 式 組 入 比 率 | 株 式 先 物 比 |
|------------------------|-------------|--------|--------|-------------|-----------|
| | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (当 期 首) 2023年10月20日 | 円 14,001 | % — | 13,952 | % — | % 97.5 |
| 10月末 | 14,106 | 0.7 | 14,061 | 0.8 | 97.7 |
| 11月末 | 15,203 | 8.6 | 15,129 | 8.4 | 98.0 |
| 12月末 | 15,396 | 10.0 | 15,348 | 10.0 | 97.9 |
| 2024年 1月末 | 16,110 | 15.1 | 16,042 | 15.0 | 98.2 |
| 2月末 | 16,837 | 20.3 | 16,817 | 20.5 | 98.0 |
| 3月末 | 17,683 | 26.3 | 17,641 | 26.4 | 98.3 |
| 4月末 | 17,094 | 22.1 | 17,034 | 22.1 | 98.3 |
| 5月末 | 17,265 | 23.3 | 17,229 | 23.5 | 98.5 |
| 6月末 | 17,809 | 27.2 | 17,776 | 27.4 | 98.5 |
| 7月末 | 17,510 | 25.1 | 17,476 | 25.3 | 98.0 |
| 8月末 | 17,156 | 22.5 | 17,131 | 22.8 | 98.7 |
| 9月末 | 17,314 | 23.7 | 17,295 | 24.0 | 98.4 |
| (当 期 末) 2024年10月21日 | 17,336 | 23.8 | 17,320 | 24.1 | 98.3 |

(注1)騰落率は期首比です。

(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」です。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2023年10月20日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるJPX日経中小型株指数(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、期末は期首比で上昇しました。

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

米経済指標が市場予想を下回ったことなどから追加利上げ観測が後退し、米国株式市場が上昇したことや、米長期金利の低下により為替が円高・米ドル安に振れたことなどから、年末にかけて国内株式市場は一進一退の展開が続きました。年明け以降は再び円安・米ドル高が進み、海外からの資金流入が続いたことや、日銀の金融緩和継続と米ハイテク株の堅調さを背景に、3月にかけて国内株式市場は大幅に上昇しました。その後は、中東情勢の緊迫化や半導体関連銘柄の業績動向に対する懸念などから上値の重い場面もありましたが、円安・米ドル高進行を受けて輸出関連株が買われたほか、国内長期金利の上昇により、金融株が反発しました。

期末にかけては、米CPI(消費者物価指数)が想定以上に軟化したことや、日銀が利上げを決定したことにも加え、米雇用統計の悪化を受け、国内株式市場は歴史的な大幅下落となりましたが、内田日銀副総裁の発言から米ドル／円が持ち直し、利下げを織り込む米株高が支えとなり、国内株式市場は反発しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるJPX日経中小型株指数(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 株式組入比率

先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。

なお、ヘッジ目的で、株価指数先物取引(TOPIX先物)を適宜活用しています。

(2) ポートフォリオ構成

現物株式については、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。

当ファンドの組入資産の内容

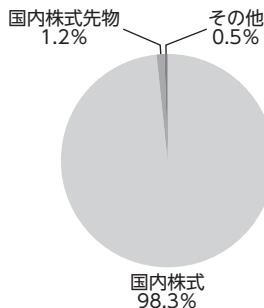
○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 国・地域 | 組入比率 |
|----|-----------------|------|------|
| 1 | JVCケンウッド | 日本 | 2.0% |
| 2 | ジーエヌアイグループ | 日本 | 1.9% |
| 3 | FPG | 日本 | 1.7% |
| 4 | フェローテックホールディングス | 日本 | 1.4% |
| 5 | 芝浦メカトロニクス | 日本 | 1.4% |
| 6 | コメダホールディングス | 日本 | 1.4% |

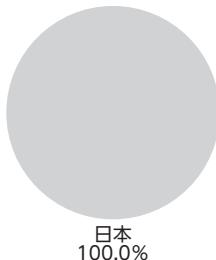
| 順位 | 銘柄名 | 国・地域 | 組入比率 |
|-------|------------|------|------|
| 7 | 物語コーポレーション | 日本 | 1.3% |
| 8 | 兼松 | 日本 | 1.3% |
| 9 | SHOEI | 日本 | 1.3% |
| 10 | マネックスグループ | 日本 | 1.2% |
| 組入銘柄数 | | | 201 |

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

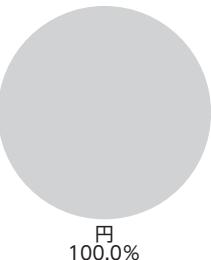
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

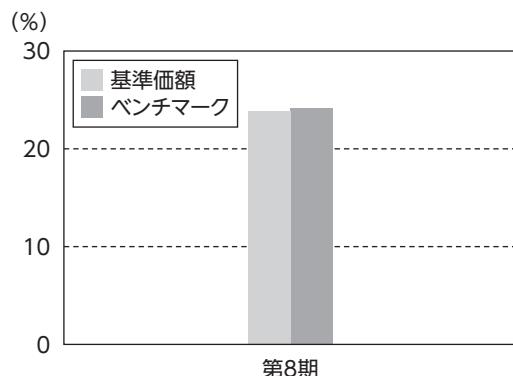


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.2%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因はキャッシュ要因および個別銘柄要因※などによるものです。

※ベンチマークでの構成比率とポートフォリオでの組入比率の差による影響

今後の運用方針

主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資し、JPX日経中小型株指数(配当込み)に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 | |
|--|---|---|--|--|
| | (2023年10月21日~2024年10月21日) | | | |
| | 金額 | 比率 | | |
| (a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション) | 11円 (10) (-) (-) (-) (-) (-) (1) | 0.067% (0.062) (-) (-) (-) (-) (-) (0.005) | (a) 売買委託手数料= $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券) | - (-) (-) (-) (-) (-) (-) | - (-) (-) (-) (-) (-) (-) | (b) 有価証券取引税= $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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 (保管費用) (監査費用) (その他) | - (-) (-) (-) | - (-) (-) (-) | (c) その他費用= $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用 | |
| 合計 | 11 | 0.067 | | |

(注1)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た結果です。

(注2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3)「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(16,623円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株式>

| | | 当期 | | | |
|--------|--------|------------------|----------------------|----------|---------------|
| | | 買付 | | 売付 | |
| 国 内 | 上 場 | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| | | 千株 136 (5) | 千円 224,019 (-) | 千株 89 | 千円 157,371 |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 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。

<先物取引の種類別取引状況>

| 種類別 | | 当期 | | | |
|-----|--------|------------|------------|----------|----------|
| | | 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 152 | 百万円 152 | 百万円 - | 百万円 - |

(注) 金額は受渡代金です。

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 | 381,391千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 196,046千円 |
| (c) 売買高比率(a) / (b) | 1.94 |

(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) (c) 売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

| 区分 | 当期 | | | | | |
|---------|-----------------|-----------------|---------------|-----------------|-----------------|---------------|
| | 買付額等A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 金銭信託 | 百万円 0.014386 | 百万円 0.014386 | % 100.0 | 百万円 0.014386 | 百万円 0.014386 | % 100.0 |
| コール・ローン | 1,098 | 109 | 9.9 | 1,099 | 109 | 9.9 |

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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

<国内株式(上場株式)>

| 銘柄 | 当期首(前期末)株数(千株) | 当期末株数(千株) | 評価額(千円) |
|-----------------------------|----------------|-----------|---------|
| 水産・農林業(0.2%) | | | |
| 雪国まいたけ | — | 0.5 | 516 |
| 鉱業(0.3%) | | | |
| 住石ホールディングス | — | 0.9 | 768 |
| 三井松島ホールディングス | 0.2 | — | — |
| 建設業(1.6%) | | | |
| ウエストホールディングス | 0.3 | 0.5 | 1,084 |
| タマホーム | 0.3 | 0.4 | 1,530 |
| 新日本建設 | 0.4 | 0.6 | 959 |
| 東洋建設 | 0.9 | — | — |
| ライト工業 | 0.5 | — | — |
| 住友電設 | 0.3 | — | — |
| 食料品(0.8%) | | | |
| S F o o d s | 0.3 | — | — |
| ファーマフーズ | 0.4 | 0.6 | 513 |
| 理研ビタミン | — | 0.5 | 1,305 |
| 化学(4.7%) | | | |
| 北の達人コーポレーション | 1.2 | — | — |
| 関東電化工業 | 0.6 | — | — |
| K Hネオケム | 0.4 | 0.8 | 1,632 |
| 旭有機材 | — | 0.3 | 1,242 |
| 恵和 | 0.2 | 0.3 | 309 |
| 扶桑化学工業 | 0.3 | 0.5 | 1,957 |
| トリケミカル研究所 | 0.4 | — | — |
| 新日本製薬 | 0.2 | — | — |
| I - n e | — | 0.1 | 175 |
| 東洋合成工業 | 0.1 | 0.1 | 723 |
| タカラバイオ | — | 1.2 | 1,260 |
| J C U | 0.3 | 0.5 | 1,707 |
| クミアイ化成工業 | — | 1.7 | 1,382 |
| 医薬品(2.6%) | | | |
| ジーエヌアイグループ | — | 1.4 | 4,270 |
| 榮研化学 | 0.5 | — | — |
| J C R ファーマ | — | 1.5 | 1,026 |
| ミズホメディ | 0.1 | 0.3 | 498 |
| 石油・石炭製品(0.2%) | | | |
| 富士石油 | 0.6 | 1.3 | 447 |
| ガラス・土石製品(0.4%) | | | |
| 品川リフラクトリーズ | — | 0.5 | 877 |
| 鉄鋼(0.6%) | | | |
| 日本冶金工業 | 0.2 | 0.3 | 1,314 |
| 非鉄金属(1.5%) | | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 0.4 | 0.6 | 669 |
| S W C C | 0.3 | 0.5 | 2,650 |
| 金属製品(2.5%) | | | |
| トーカロ | 0.8 | 1.3 | 2,372 |
| R S T e c h n o l o g i e s | 0.2 | 0.3 | 1,203 |
| 横河リッジホールディングス | 0.4 | 0.7 | 1,838 |

| 銘柄 | 当期首(前期末)株数(千株) | 当期末株数(千株) | 評価額(千円) |
|-----------------------------|----------------|-----------|---------|
| 機械(4.0%) | | | |
| ツガミ | — | 0.9 | 1,301 |
| 岡本工作機械製作所 | — | 0.1 | 375 |
| オプトラン | 0.5 | — | — |
| 野村マイクロ・サイエンス | 0.1 | 0.6 | 1,339 |
| 日精エー・エス・ピー機械 | 0.1 | 0.2 | 909 |
| T O W A | 0.3 | — | — |
| 濱谷工業 | 0.3 | — | — |
| オルガノ | 0.4 | — | — |
| フクシマガリレイ | 0.2 | 0.3 | 1,716 |
| 竹内製作所 | 0.4 | — | — |
| P I L L A R | 0.3 | 0.4 | 1,792 |
| スター精密 | — | 0.7 | 1,382 |
| 電気機器(12.1%) | | | |
| 芝浦メカトロニクス | — | 0.3 | 3,123 |
| ヤーマン | 0.5 | 0.9 | 783 |
| J V C ケンウッド | 2.6 | 3.5 | 4,385 |
| I D E C | 0.4 | 0.7 | 1,754 |
| シライ電子工業 | — | 0.3 | 165 |
| M C J | 1.2 | 1.8 | 2,665 |
| ワコム | 2.2 | 3.1 | 2,120 |
| s a n t e c H o l d i n g s | — | 0.2 | 1,156 |
| 日本電波工業 | 0.4 | 0.5 | 540 |
| マイコー | 0.3 | 0.4 | 2,464 |
| 日置電機 | — | 0.2 | 1,668 |
| 日本マイクロニクス | 0.5 | — | — |
| メガチップス | 0.2 | 0.3 | 1,614 |
| フェローテックホールディングス | — | 1.2 | 3,126 |
| 山一電機 | 0.2 | 0.4 | 1,006 |
| 輸送用機器(0.9%) | | | |
| カヤバ | 0.3 | 0.4 | 1,938 |
| 精密機器(1.3%) | | | |
| ノーリツ鋼機 | 0.3 | 0.4 | 1,596 |
| A & D ホロンドホールディングス | 0.4 | 0.6 | 1,293 |
| その他製品(4.1%) | | | |
| 三井松島ホールディングス | — | 0.4 | 1,828 |
| 壽屋 | — | 0.1 | 157 |
| トランザクション | 0.2 | 0.3 | 784 |
| フルヤ金属 | 0.1 | 0.4 | 1,574 |
| S H O E I | — | 1.2 | 2,804 |
| N I S S H A | 0.5 | — | — |
| ローランド | — | 0.3 | 1,182 |
| グローブライド | 0.2 | 0.4 | 752 |
| 電気・ガス業(0.7%) | | | |
| グリムス | — | 0.2 | 554 |
| イーレックス | 0.5 | — | — |
| レノバ | 0.8 | — | — |
| 北海道瓦斯 | — | 1.7 | 1,001 |

| 銘柄 | 当期首(前期末) | 当期 | 末 |
|-----------------------|------------|------------|-------------|
| | 株数 (千株) | 株数 (千株) | 評価額 (千円) |
| メタウォーター | 0.3 | — | — |
| 陸運業(0.5%) | | | |
| S B Sホールディングス | 0.3 | 0.4 | 1,030 |
| サカイ引越センター | 0.3 | — | — |
| 海運業(1.8%) | | | |
| N Sユナイテッド海運 | 0.2 | 0.2 | 924 |
| 明海グループ | — | 0.5 | 355 |
| 飯野海運 | 1 | 1.6 | 2,044 |
| 乾汽船 | 0.4 | 0.5 | 575 |
| 倉庫・運輸関連業(1.8%) | | | |
| 三井倉庫ホールディングス | 0.3 | 0.4 | 2,744 |
| エーアイティー | 0.2 | 0.3 | 537 |
| 内外トランスライン | 0.1 | 0.2 | 578 |
| 情報・通信業(12.5%) | | | |
| システィナ | 4.8 | 6.6 | 2,442 |
| デジタルアーツ | 0.2 | 0.3 | 1,581 |
| ソフトクリエイトホールディングス | — | 0.4 | 830 |
| エニグモ | 0.4 | — | — |
| クロス・マーケティンググループ | 0.2 | — | — |
| デジタルハーツホールディングス | 0.2 | — | — |
| じげん | — | 1.3 | 802 |
| フィックスターズ | 0.3 | 0.4 | 612 |
| ティーガイア | 0.3 | 0.5 | 1,333 |
| テクマトリックス | 0.5 | 0.8 | 1,844 |
| ドリコム | 0.3 | — | — |
| アバントグループ | 0.4 | 0.6 | 1,331 |
| コムチュア | 0.4 | 0.6 | 1,142 |
| アイル | 0.1 | 0.2 | 643 |
| マークラインズ | 0.2 | 0.3 | 885 |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 0.2 | 0.2 | 432 |
| P R T I M E S | 0.1 | 0.1 | 157 |
| ダブルスタンダード | 0.1 | 0.1 | 171 |
| アカツキ | 0.1 | — | — |
| カナミックネットワーク | 0.3 | 0.5 | 290 |
| チェンジホールディングス | — | 1 | 1,237 |
| オークネット | 0.1 | — | — |
| マクロミル | — | 0.9 | 738 |
| オロ | 0.1 | 0.2 | 461 |
| プラスアルファ・コンサルティング | — | 0.6 | 1,275 |
| インフォコム | 0.4 | — | — |
| I P S | 0.1 | 0.1 | 234 |
| ウイングアーク 1 s t | — | 0.5 | 1,622 |
| ベース | 0.1 | 0.2 | 610 |
| フューチャー | 0.6 | 1.1 | 1,941 |
| S Bテクノロジー | 0.1 | — | — |
| ビジネスエンジニアリング | — | 0.1 | 411 |
| アルゴグラフィックス | 0.3 | 0.4 | 2,096 |
| U-NEXT HOLDINGS | 0.3 | — | — |
| 日本通信 | 2.6 | 4.3 | 640 |
| ファイバーゲート | 0.2 | 0.2 | 207 |
| 福井コンピュータホールディングス | 0.2 | 0.3 | 811 |
| ミロク情報サービス | 0.3 | 0.4 | 740 |

| 銘柄 | 当期首(前期末) | 当期 | 末 |
|-------------------------|------------|------------|-------------|
| | 株数 (千株) | 株数 (千株) | 評価額 (千円) |
| 卸売業(10.9%) | | | |
| 東京エレクトロン デバイス | 0.3 | 0.5 | 1,775 |
| 円谷フィールズホールディングス | — | 0.7 | 1,618 |
| あい ホールディングス | 0.5 | 0.7 | 1,665 |
| グリムス | 0.1 | — | — |
| TOKAIホールディングス | 1.5 | — | — |
| コメダホールディングス | 0.7 | 1.1 | 3,097 |
| 松田産業 | 0.2 | 0.4 | 1,278 |
| 日本ライフライン | 0.9 | 1.2 | 1,458 |
| I D O M | 0.9 | 1.2 | 1,539 |
| BuySell Technologies | 0.1 | 0.1 | 445 |
| 蝶理 | — | 0.3 | 1,233 |
| 兼松 | 1 | 1.2 | 2,817 |
| 日本紙パルプ商事 | 0.2 | 2.2 | 1,513 |
| 神鋼商事 | — | 0.1 | 637 |
| 中央自動車工業 | — | 0.4 | 1,902 |
| 伊藤忠エヌクス | 0.7 | — | — |
| 加賀電子 | 0.2 | 0.8 | 2,276 |
| KPPグループホールディングス | 0.7 | 1.2 | 824 |
| 小売業(7.4%) | | | |
| ハローズ | 0.2 | 0.3 | 1,323 |
| コメ兵ホールディングス | — | 0.2 | 785 |
| トレジャー・ファクトリー | — | 0.3 | 415 |
| 物語コーポレーション | — | 0.8 | 2,964 |
| H a m e e | 0.1 | — | — |
| シュッピン | 0.2 | 0.4 | 432 |
| オイシックス・ラ・大地 | 0.4 | — | — |
| J Mホールディングス | 0.2 | 0.3 | 909 |
| 力の源ホールディングス | — | 0.3 | 340 |
| リミックスポイント | — | 3.4 | 523 |
| G-7ホールディングス | 0.4 | 0.5 | 826 |
| コーナン商事 | 0.4 | — | — |
| 西松屋チェーン | 0.7 | — | — |
| V Tホールディングス | 1.1 | 1.8 | 828 |
| スクロール | 0.5 | 0.7 | 676 |
| Genky Drug Stores | 0.1 | 0.4 | 1,332 |
| ギフトホールディングス | — | 0.2 | 657 |
| アーカランズ | 0.9 | 1.4 | 2,359 |
| 日本KFCホールディングス | 0.3 | — | — |
| ベルク | 0.2 | 0.3 | 1,998 |
| 銀行業(0.9%) | | | |
| あいちフィナンシャルグループ | 0.5 | 0.9 | 2,053 |
| 証券、商品先物取引業(5.1%) | | | |
| F P G | 0.9 | 1.5 | 3,708 |
| GM0フィナンシャルホールディングス | 0.8 | 1.2 | 787 |
| ジャフコ グループ | 0.9 | 1.3 | 2,616 |
| マネックスグループ | 3 | 4.2 | 2,801 |
| H Sホールディングス | — | 0.2 | 188 |
| トレイダーズホールディングス | 0.3 | 0.5 | 434 |
| スペーカス・グループ | 0.3 | 0.5 | 673 |
| その他金融業(1.5%) | | | |
| ジェイリース | 0.1 | 0.3 | 458 |

| 銘柄 | 当期首(前期末) | 当期 | 末 |
|---------------------|------------|------------|-------------|
| | 株数 (千株) | 株数 (千株) | 評価額 (千円) |
| S B I アルヒ | 0.4 | — | — |
| プレミアグループ | 0.5 | 0.7 | 1,580 |
| 日本リビング保証 | — | 0.1 | 273 |
| イー・ギャランティ | 0.5 | 0.7 | 1,068 |
| 不動産業(5.7%) | | | |
| タスキホールディングス | — | 0.6 | 408 |
| 日本駐車場開発 | 3 | 5.1 | 1,162 |
| L A ホールディングス | 0.1 | 0.1 | 461 |
| ディアイ・ライフ | 0.5 | 0.7 | 592 |
| プレサンスコーポレーション | 0.4 | — | — |
| シーアールイー | 0.2 | 0.2 | 248 |
| ケイアイスター不動産 | 0.1 | 0.2 | 790 |
| グッドコムアセット | 0.3 | 0.3 | 255 |
| ジェイ・エス・ビー | 0.1 | 0.2 | 561 |
| ロードスター・キャピタル | 0.2 | 0.2 | 463 |
| グローバル・リンク・マネジメント | — | 0.1 | 224 |
| ウェルス・マネジメント | 0.1 | 0.2 | 217 |
| レーサム | — | 0.2 | 1,180 |
| 日本エスコン | 0.5 | 0.8 | 797 |
| カチタス | — | 1.2 | 2,353 |
| トーセイ | 0.5 | 0.7 | 1,681 |
| サンフロンティア不動産 | 0.5 | 0.6 | 1,104 |
| サービス業(13.4%) | | | |
| ジェイエイシーリクルートメント | 0.3 | 1.6 | 1,182 |
| メンバーズ | 0.1 | — | — |
| U T グループ | 0.4 | 0.6 | 1,599 |
| アイティメディア | 0.1 | 0.2 | 325 |
| ケアネット | 0.6 | 0.9 | 607 |
| パソナグループ | 0.4 | 0.5 | 1,004 |
| リンクアンドモチベーション | — | 1.1 | 658 |
| アミタホールディングス | 0.1 | — | — |
| シミックホールディングス | 0.1 | — | — |
| デジタルホールディングス | 0.2 | 0.2 | 199 |
| 新日本科学 | 0.3 | 0.4 | 514 |
| ワールドホールディングス | 0.1 | 0.2 | 390 |
| ライク | 0.1 | 0.2 | 282 |
| エスプール | 0.8 | 1.4 | 506 |
| バリューコマース | 0.3 | 0.4 | 450 |
| J P ホールディングス | 0.8 | 1.1 | 771 |
| プレステージ・インターナショナル | 1.2 | 2.1 | 1,455 |
| クイック | 0.2 | 0.3 | 605 |
| アルプス技研 | 0.3 | 0.4 | 1,138 |
| ビー・エム・エル | 0.4 | 0.6 | 1,627 |
| リソー教育 | 1.3 | — | — |
| クリーク・アンド・リバー社 | 0.2 | 0.2 | 316 |

| 銘柄 | 当期首(前期末) | 当期 | 末 |
|-----------------------|-----------------|------------|--------------------|
| | 株数 (千株) | 株数 (千株) | 評価額 (千円) |
| S B I グローバルアセットマネジメント | 0.5 | 0.9 | 531 |
| シダックス | 0.5 | — | — |
| フルキャストホールディングス | 0.3 | 0.4 | 625 |
| アドベンチャー | — | 0.1 | 390 |
| アイ・アルジャパンホールディングス | 0.2 | 0.2 | 173 |
| K e e P e r 技研 | 0.2 | 0.3 | 1,257 |
| イー・ガーディアン | 0.1 | 0.2 | 374 |
| ベクトル | 0.5 | 0.5 | 483 |
| チャーム・ケア・コボレーション | 0.3 | 0.4 | 521 |
| キャリアリンク | 0.1 | 0.2 | 498 |
| I B J | 0.2 | 0.3 | 201 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 0.2 | 0.4 | 956 |
| E R I ホールディングス | — | 0.1 | 190 |
| シグマクシス・ホールディングス | 0.4 | 0.6 | 1,030 |
| ウィルグループ | 0.3 | — | — |
| フリークアウト・ホールディングス | — | 0.2 | 139 |
| エラン | 0.4 | 0.6 | 564 |
| ベルシステム24ホールディングス | 0.4 | 0.5 | 659 |
| エアトリ | — | 0.3 | 318 |
| ストライク | 0.1 | 0.2 | 931 |
| ソラスト | 0.8 | 1.2 | 609 |
| インソース | 0.6 | 1 | 1,041 |
| Orchestra Holdings | 0.1 | — | — |
| アイモバイル | — | 0.6 | 315 |
| ジーニー | 0.1 | 0.1 | 133 |
| ミダックホールディングス | 0.2 | — | — |
| マネジメントソリューションズ | — | 0.2 | 399 |
| ポート | 0.1 | 0.2 | 388 |
| Macbee Planet | — | 0.2 | 529 |
| L I T A L I C O | 0.2 | 0.3 | 380 |
| 船井総研ホールディングス | 0.6 | 0.9 | 2,249 |
| 合計 | 株数・金額 銘柄数×比率 | 86 | 139 |
| | | 192 | 200 |
| | | | 220,529 <98.3%> |

(注1)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です。

(注2)合計欄の()内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

| 銘柄 | 別 | 当期 | | | |
|----|---------|----|------------|----|------------|
| | | 買建 | 額 (百万円) | 売建 | 額 (百万円) |
| 国内 | ミニTOPIX | | 2 | | — |

投資信託財産の構成

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|---------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 株式 | 千円 220,529 | % 98.3 |
| コール・ローン等、その他 | 3,723 | 1.7 |
| 投資信託財産総額 | 224,252 | 100.0 |

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項目 | 当期末 2024年10月21日現在 |
|-----------------|----------------------|
| (A)資産 | 224,252,216円 |
| コール・ローン等 | 1,545,925 |
| 株式(評価額) | 220,529,100 |
| 未収入金 | 117,562 |
| 未収配当金 | 2,010,503 |
| 未収利息 | 9 |
| 差入委託証拠金 | 49,117 |
| (B)純資産総額(A) | 224,252,216 |
| 元本 | 129,359,229 |
| 次期繰越損益金 | 94,892,987 |
| (C)受益権総口数 | 129,359,229口 |
| 1万口当たり基準価額(B/C) | 17,336円 |

■損益の状況

| 項目 | 当期 自2023年10月21日 至2024年10月21日 |
|---------------------|------------------------------------|
| (A)配当等収益 受取配当金 | 5,657,098円 5,653,290 |
| 受取利息 | 2,801 |
| その他収益金 | 1,284 |
| 支払利息 | △277 |
| (B)有価証券売買損益 売買益 | 29,194,672 40,189,855 |
| 売買損 | △10,995,183 |
| (C)先物取引等取引損益 取引益 | 484,046 1,359,666 |
| 取引損 | △875,620 |
| (D)当期損益金(A+B+C) | 35,335,816 |
| (E)前期繰越損益金 | 36,552,469 |
| (F)追加信託差損益金 | 63,038,461 |
| (G)解約差損益金 | △40,033,759 |
| (H)計(D+E+F+G) | 94,892,987 |
| 次期繰越損益金(H) | 94,892,987 |

(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算によるものを含みます。

(注2) (F)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。

(注3) (G)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。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は91,361,396円、期中追加設定元本額は101,609,026円、期中一部解約元本額は63,611,193円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

SMT JPX日経中小型株インデックス・オープン

129,359,229円

お知らせ

該当事項はありません。