

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2014年1月21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 インデックス400・ 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 インデックス400 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 インデックス400・ 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 インデックス400 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日経インデックス400・オープン

運用報告書(全体版)

第22期(決算日 2024年10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		期中騰落率			
第18期(2022年10月20日)	円 17,039	円 0	% △0.4		% △0.1	% 97.6	% 2.2	百万円 9,698
第19期(2023年4月20日)	18,676	0	9.6	23,002.76	9.9	97.7	2.1	10,582
第20期(2023年10月20日)	20,816	0	11.5	25,693.56	11.7	98.2	1.6	11,789
第21期(2024年4月22日)	25,027	0	20.2	30,843.33	20.0	97.9	1.8	13,331
第22期(2024年10月21日)	25,679	0	2.6	31,721.17	2.8	98.0	1.6	14,177

(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「買建比率－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		騰落率			
(当期首) 2024年4月22日	円 25,027	% —		% —	% 97.9	% 1.8
4月末	25,896	3.5	31,913.53	3.5	97.6	2.3
5月末	26,266	5.0	32,392.40	5.0	98.4	1.5
6月末	26,701	6.7	32,940.87	6.8	99.0	1.0
7月末	26,608	6.3	32,838.04	6.5	99.1	0.8
8月末	25,843	3.3	31,903.89	3.4	99.1	0.8
9月末	25,378	1.4	31,343.39	1.6	98.3	1.7
(当期末) 2024年10月21日	25,679	2.6	31,721.17	2.8	98.0	1.6

(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「買建比率－売建比率」です。

ベンチマークは、JPX日経インデックス400（配当込み）です。

【「JPX日経インデックス400」】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400銘柄で構成される株価指数です。採用される400銘柄は、企業の健全性や流動性の観点から1,000銘柄に絞り込まれた上で、ROE、営業利益、時価総額の定量評価に定性評価を加味し、選定されます。起算日は2013年8月30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、

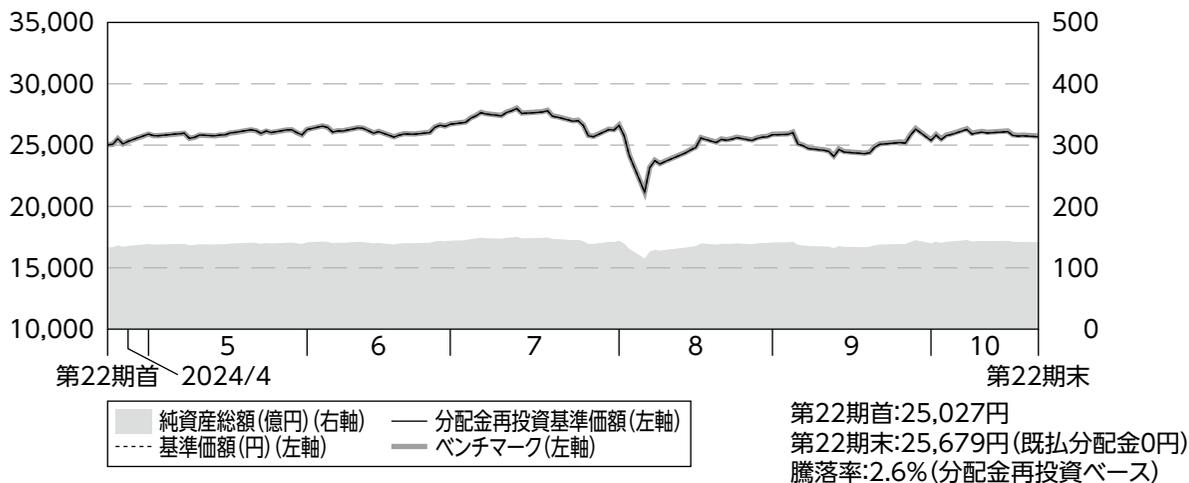
【同指数】自体及び【同指数】を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有します。

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。

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

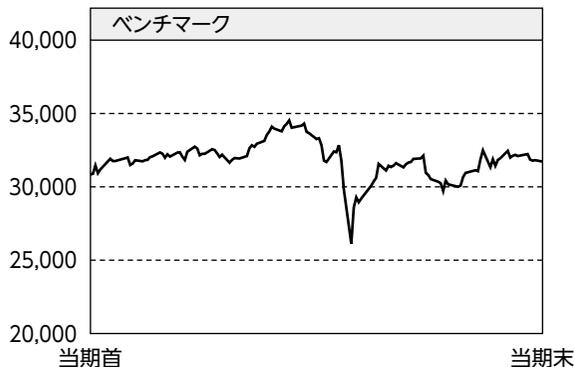


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2024年4月22日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるJPX日経インデックス400(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。

期初、日銀金融政策決定会合での金融政策の現状維持が好感され、国内株式市場は上昇しましたが、円買いの為替介入への警戒感や米ハイテク関連株の値動き、および欧州の政治不安などを受けて上値の重い展開となりました。国内長期金利の上昇、円安・米ドル高進行を受け、7月にかけて金融株や輸出関連株が上昇しましたが、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。

その後は、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が、期末にかけては、自民党総裁選やその後の衆議院解散による総選挙を控え、一進一退の展開となりました。

当ファンドのポートフォリオ

株式への投資は「JPX日経インデックス400 マザーファンド」の組み入れにより行いました。

【「JPX日経インデックス400 マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるJPX日経インデックス400(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。

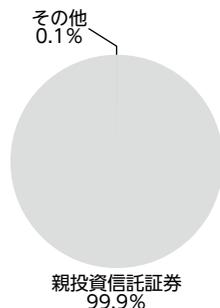
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

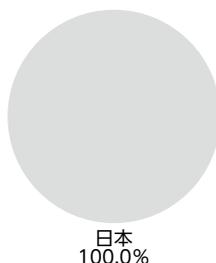
	当期末
	2024年10月21日
JPX日経インデックス400 マザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

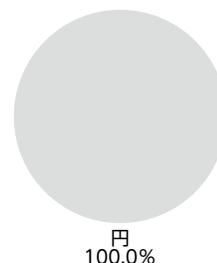
○資産別配分



○国別配分



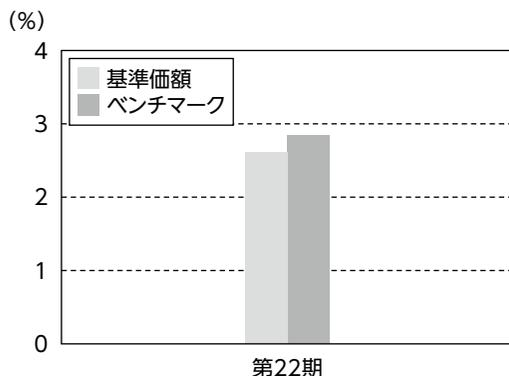
○通貨別配分



(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、信託報酬要因です。

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す。

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22期	
	2024年4月23日~2024年10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)	15,679

(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)—印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

JPX日経インデックス400 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日経インデックス400(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4月23日~2024年10月21日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	53円	0.203%	(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26,115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)	(20)	(0.077)	
(販売会社)	(26)	(0.099)	
(受託会社)	(7)	(0.027)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 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
(株式)	(0)	(0.000)	
(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)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 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
(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	1	0.003	(d) 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
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(1)	(0.003)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	54	0.207	

(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。
なお、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。

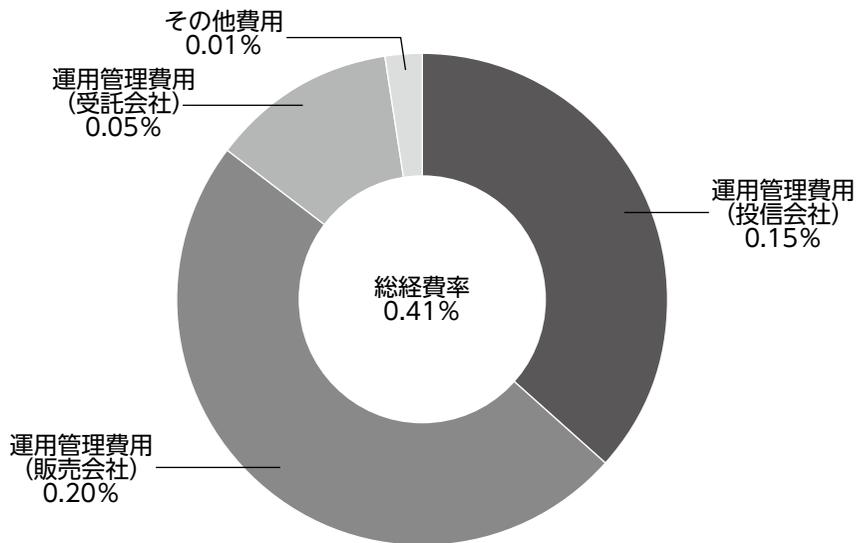
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.41%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日経インデックス400 マザーファンド	千口 309,817	千円 828,644	千口 136,154	千円 377,991

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日経インデックス400 マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	11,575,560千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	21,430,625千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.54

(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	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
コール・ローン	百万円 4,719	百万円 1,007	% 21.3	百万円 4,708	百万円 1,004	% 21.3

(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日経インデックス400 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	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
コール・ローン	百万円 35,379	百万円 7,494	% 21.2	百万円 35,453	百万円 7,507	% 21.2

<平均保有割合 65.0%>

(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。

■利害関係人の発行する有価証券等

<JPX日経インデックス400 マザーファンド>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	24百万円	13百万円	99百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラストグループ株式会社です。

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	口 数	評 価 額
JPX日経インデックス400 マザーファンド	千口 5,055,982	千口 5,229,645	千円 14,170,770

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、8,192,685千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
JPX日経インデックス400 マザーファンド	千円 14,170,770	% 99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	67,728	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	14,238,498	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	14,238,498,704円
コール・ローン等	57,366,988
JPX日経インデックス400 マザーファンド(評価額)	14,170,770,124
未 収 入 金	10,361,253
未 収 利 息	339
(B)負 債	60,617,864
未 払 解 約 金	31,824,052
未 払 信 託 報 酬	28,409,953
そ の 他 未 払 費 用	383,859
(C)純 資 産 総 額(A-B)	14,177,880,840
元 本	5,521,167,310
次 期 繰 越 損 益 金	8,656,713,530
(D)受 益 権 総 口 数	5,521,167,310口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,679円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2024年 4月23日 至 2024年10月21日
(A)配 当 等 収 益	28,256円
受 取 利 息	28,256
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	354,836,055
売 買 益	404,347,696
売 買 損	△49,511,641
(C)信 託 報 酬 等	△28,793,812
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	326,070,499
(E)前 期 繰 越 損 益 金	3,538,557,967
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	4,792,085,064
(配 当 等 相 当 額)	(4,336,094,109)
(売 買 損 益 相 当 額)	(455,990,955)
(G)計 (D+E+F)	8,656,713,530
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	8,656,713,530
追 加 信 託 差 損 益 金	4,792,085,064
(配 当 等 相 当 額)	(4,338,735,243)
(売 買 損 益 相 当 額)	(453,349,821)
分 配 準 備 積 立 金	3,864,628,466

- (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>

※当ファンドの期首元本額は5,326,814,840円、期中追加設定元本額は611,515,498円、期中一部解約元本額は417,163,028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)	153,102,122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)	172,968,377円
(C) 収益調整金額	4,792,085,064円
(D) 分配準備積立金額	3,538,557,967円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	8,656,713,530円
(F) 期末残存口数	5,521,167,310口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	15,679円
(H) 分配金額(1万口当たり)	—円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	—円

お知らせ

該当事項はありません。

JPX日経インデックス400 マザーファンド

運用報告書

第11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2014年1月7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上げます。

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、金額の表記未满是切捨て、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		株式先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第7期(2020年10月20日)	14,639	2.9	17,186.91	2.9	98.4	47,872
第8期(2021年10月20日)	18,662	27.5	21,909.17	27.5	98.3	36,450
第9期(2022年10月20日)	17,828	△4.5	20,936.60	△4.4	97.7	12,762
第10期(2023年10月20日)	21,873	22.7	25,693.56	22.7	98.2	16,223
第11期(2024年10月21日)	27,097	23.9	31,721.17	23.5	98.1	22,199

(注)株式先物比率は「買建比率－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		株式先物率 比
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2023年10月20日	21,873	—	25,693.56	—	98.2
10月末	21,746	△0.6	25,542.53	△0.6	98.3
11月末	23,108	5.6	27,146.11	5.7	98.2
12月末	23,154	5.9	27,099.47	5.5	99.1
2024年 1月末	24,973	14.2	29,229.42	13.8	99.1
2月末	26,187	19.7	30,646.53	19.3	99.0
3月末	27,395	25.2	32,059.27	24.8	98.4
4月末	27,273	24.7	31,913.53	24.2	97.6
5月末	27,672	26.5	32,392.40	26.1	98.5
6月末	28,140	28.7	32,940.87	28.2	99.0
7月末	28,052	28.2	32,838.04	27.8	99.1
8月末	27,254	24.6	31,903.89	24.2	99.2
9月末	26,773	22.4	31,343.39	22.0	98.3
(当期末) 2024年10月21日	27,097	23.9	31,721.17	23.5	98.1

(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。

ベンチマークは、JPX日経インデックス400（配当込み）です。

【「JPX日経インデックス400」】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400銘柄で構成される株価指数です。採用される400銘柄は、企業の健全性や流動性の観点から1,000銘柄に絞り込まれた上で、ROE、営業利益、時価総額の定量評価に定性評価を加味し、選定されます。起算日は2013年8月30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。

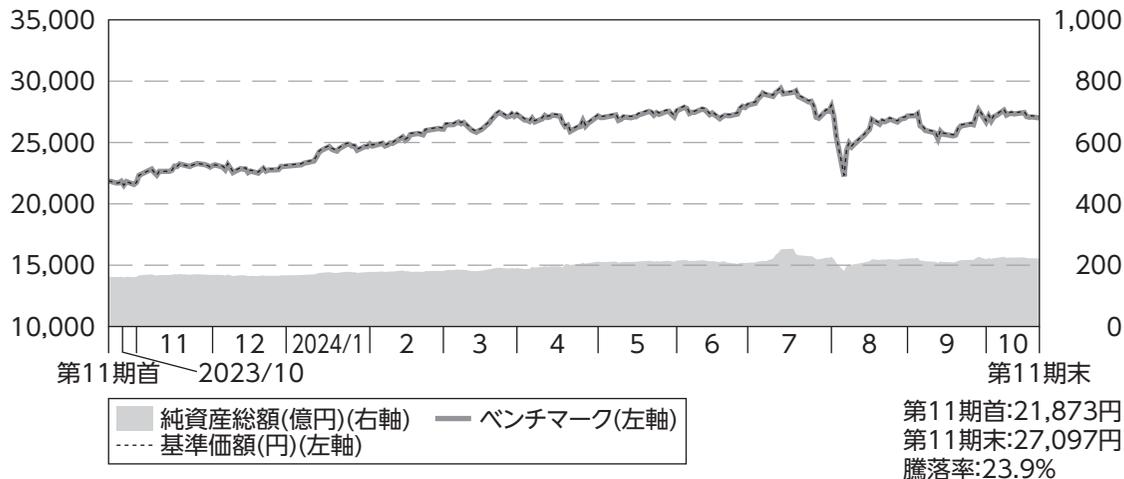
【同指数】は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）及び株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」という。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPX及び日経は、【同指数】自体及び【同指数】を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有します。

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。

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日経インデックス400(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日経インデックス400(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

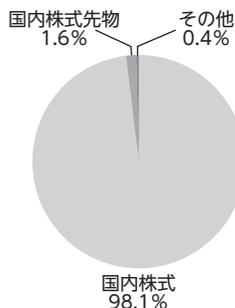
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	リクルートホールディングス	日本	1.7%
2	日立製作所	日本	1.7%
3	JPX日経インデックス400先物 2412	日本	1.6%
4	ソニーグループ	日本	1.5%
5	HOYA	日本	1.5%
6	伊藤忠商事	日本	1.5%

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	三菱重工業	日本	1.5%
8	日本電信電話	日本	1.5%
9	信越化学工業	日本	1.4%
10	キーエンス	日本	1.4%
組入銘柄数		401	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

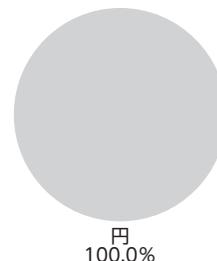
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

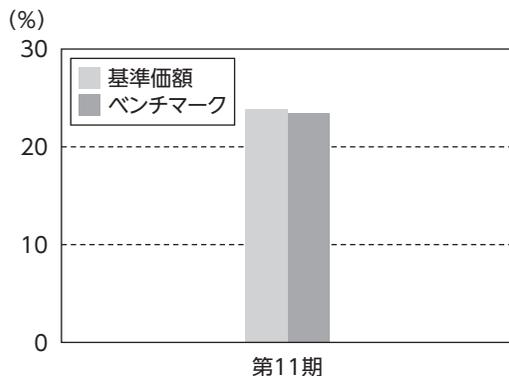


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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1.6%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。

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日経インデックス400(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	1円	0.004%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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
(株式)	(0)	(0.001)	
(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)	(1)	(0.003)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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
(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)	(-)	(-)	
(c) その他費用	5	0.020	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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、損害賠償請求訴訟に係る費用
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(5)	(0.020)	
合計	6	0.024	

(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(25,977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	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場	千株 4,023 (2,488)	千円 9,387,717 (-)	千株 2,394	千円 6,635,740	

(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 6,474	百万円 6,439	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	16,023,458千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	19,334,744千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.82

(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 2	百万円 2	100.0	百万円 2	百万円 2	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	58,398	8,937	15.3	58,893	8,906	15.1

(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。

■利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	34百万円	18百万円	99百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラストグループ株式会社です。

※ 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)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(0.0%)			
ニッスイ	9.8	11.7	10,748
鉱業(0.3%)			
三井松島ホールディングス	0.4	—	—
I N P E X	36.3	35.3	70,564
石油資源開発	—	6.8	7,772
建設業(2.3%)			
ウエストホールディングス	0.8	—	—
ショーボンドホールディングス	1.3	1.5	8,227
ミライト・ワン	3.2	—	—
タマホーム	0.6	0.7	2,677
安藤・間	5.7	6.8	7,718
コムシスホールディングス	3.1	3.7	11,503
大成建設	6.4	7.5	46,432
大林組	24.6	29.2	54,253
清水建設	19.5	—	—
長谷工コーポレーション	7.1	7.5	14,238
鹿島建設	15.2	18.1	48,055
住友林業	5.9	7.1	46,426
大和ハウス工業	19	22.6	102,152
積水ハウス	20.8	24.7	94,724
関電工	3.8	5.1	11,362
エクシオグループ	3.2	8	12,444
九電工	1.7	1.8	11,127
高砂熱学工業	—	2.2	10,780
インフロンア・ホールディングス	7.2	9.4	11,077
食料品(3.7%)			
森永製菓	1.2	3.4	9,761
寿スピリッツ	—	3.9	7,768
カルビー	3.2	3.8	12,901
森永乳業	1.3	2.9	10,121
ヤクルト本社	9.9	11.7	39,159
明治ホールディングス	8.5	10	35,400
日本ハム	2.7	3.5	18,256
アサヒグループホールディングス	15.9	61.5	107,748
キリンホールディングス	28.7	34.1	75,275
宝ホールディングス	4.7	5.5	6,663
サントリー食品インターナショナル	4.9	5.8	30,479
キッコーマン	4.6	27.1	45,297
味の素	16.6	19.3	108,639
ニチレイ	3.2	3.8	16,283
東洋水産	3.5	4.1	36,059
日清食品ホールディングス	2.4	8.6	35,045
日本たばこ産業	41.9	49.8	203,881
繊維製品(0.3%)			
東レ	47	55.8	45,968
ゴールドウイン	1.2	1.5	12,633

銘柄	当 期 首 (前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
パルプ・紙(0.1%)			
王子ホールディングス	29.2	34.7	19,709
レンゴー	6.4	—	—
化学(5.9%)			
クラレ	10.2	12.1	24,647
旭化成	43.8	—	—
住友化学	52	—	—
日産化学	3.3	3.9	20,732
東ソー	9.4	11.1	21,078
トクヤマ	2.3	—	—
デンカ	2.6	—	—
信越化学工業	51.6	54.2	321,677
エア・ウォーター	6.6	7.9	15,408
日本酸素ホールディングス	6.8	8.1	41,974
三菱瓦斯化学	5.2	6.1	16,424
三井化学	5.8	6.9	24,474
東京応化工業	1.1	4	14,392
三菱ケミカルグループ	47.3	60.9	50,461
KHネオケム	1.1	1.5	3,061
ダイセル	9.8	10.3	13,709
住友ベークライト	1	2.3	9,108
積水化学工業	14.2	16.6	36,420
日本ゼオン	4.2	—	—
アイカ工業	1.8	—	—
扶桑化学工業	0.7	0.9	3,523
ADEKA	2.4	2.9	8,069
日油	2.2	7.5	19,226
花王	15.9	20.3	139,420
日本ペイントホールディングス	37.2	36.9	38,320
関西ペイント	5.6	7.2	17,838
太陽ホールディングス	1.1	1.5	5,895
富士フイルムホールディングス	13.5	46.4	170,102
資生堂	14.7	17.4	59,299
ライオン	9.2	10.6	17,839
コーセー	1.4	—	—
小林製薬	2	2.2	12,676
タカラバイオ	1.9	2.2	2,310
デクセリアルズ	1.9	6.2	14,923
日東電工	5.1	26.4	64,244
ニフコ	2.5	2.5	8,642
ユニ・チャーム	14.6	17.4	84,877
医薬品(6.2%)			
協和キリン	8.5	10.1	26,653
武田薬品工業	54.4	73.8	316,897
アステラス製薬	66.3	73.2	130,662

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
塩野義製薬	8.9	30.4	63,779	
日本新薬	1.7	2.2	9,246	
中外製薬	22	26.1	182,778	
エーザイ	8.5	10.1	53,156	
ロート製薬	6.8	8.1	28,123	
小野薬品工業	13.5	17.1	34,319	
JCRファーマ	2.4	—	—	
第一三共	54.1	61.2	301,042	
大塚ホールディングス	14.6	20.8	188,385	
ペプチドリーム	3.4	4	11,872	
石油・石炭製品(0.8%)				
出光興産	7.8	43.3	45,118	
ENEOSホールディングス	119.1	132.1	102,905	
コスモエネルギーホールディングス	2.8	2.5	19,312	
ゴム製品(0.8%)				
横浜ゴム	3.6	4.2	13,309	
TOYO TIRE	4	4.8	10,272	
ブリヂストン	20.6	24.4	137,372	
住友ゴム工業	6.9	8.2	12,673	
ガラス・土石製品(0.7%)				
AGC	6.5	8.1	37,746	
東海カーボン	—	7.7	6,653	
TOTO	4.6	5.5	28,187	
日本碍子	8.2	9.7	18,182	
日本特殊陶業	5.3	6.8	28,335	
MARUWA	0.3	0.3	12,555	
フジインコーポレーテッド	1.7	2.2	5,176	
ニチアス	1.8	2.1	11,886	
鉄鋼(1.1%)				
日本製鉄	32.3	40.7	124,460	
神戸製鋼所	—	17.3	28,916	
JFEホールディングス	20.1	23.9	44,119	
東京製鐵	2	2.4	4,665	
大和工業	—	1.6	11,427	
丸一鋼管	2.2	2.6	8,639	
大同特殊鋼	—	5.4	7,308	
日本冶金工業	0.5	0.6	2,628	
非鉄金属(0.9%)				
大紀アルミニウム工業所	1	—	—	
三井金属鉱業	2.1	2.5	12,240	
住友金属鉱山	8.4	10	44,240	
DOWAホールディングス	1.6	2.1	10,968	
住友電気工業	24.9	32.1	74,488	
フジクラ	—	10.1	51,823	
AREホールディングス	2.9	3.2	5,801	
金属製品(0.4%)				
SUMCO	12.8	16.3	24,376	
三和ホールディングス	6.7	8.5	31,229	
リンナイ	3.9	4.1	14,022	
日本発條	—	7.6	14,155	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
機械(6.4%)				
三浦工業	3	3.5	12,743	
ツガミ	—	1.8	2,602	
アマダ	11.3	12.7	19,570	
F U J I	3.1	—	—	
DMG森精機	4.3	5.3	15,380	
ディスコ	3.4	4	158,160	
野村マイクロ・サイエンス	—	1.1	2,456	
ナブテスコ	4.4	5.3	13,061	
SMC	2.3	2.5	160,625	
小松製作所	33.1	39.4	157,718	
住友重機械工業	4.2	5	17,470	
日立建機	2.8	3.3	11,391	
TOWA	—	2.7	5,456	
ローツェ	0.4	4.4	9,134	
クボタ	37.1	43.9	87,536	
荏原製作所	2.9	17.2	40,626	
ダイキン工業	8.4	10	187,900	
オルガノ	1	1	7,350	
ダイフク	10.9	14.2	39,383	
SANKYO	1.4	8.1	17,253	
竹内製作所	1.3	1.5	7,155	
セガサミーホールディングス	5.7	7.5	22,065	
ホンザキ	4.2	5.4	28,198	
マキタ	8.8	9.6	46,224	
三菱重工業	12.4	146.9	325,971	
I H I	4.5	—	—	
電気機器(17.4%)				
イビデン	4.1	4.4	21,788	
ブラザー工業	9.4	11.2	33,824	
ミネベアミツミ	12.3	14.6	40,887	
日立製作所	27.7	93.9	371,374	
三菱電機	73.1	92	217,856	
富士電機	4.3	5.1	41,335	
安川電機	8.4	9.1	39,885	
ニデック	17.2	—	—	
JVCケンウッド	—	6.6	8,269	
オムロン	6.5	6.4	39,872	
MCJ	2.9	3.5	5,183	
日本電気	10	11	146,630	
富士通	7	77.3	236,460	
ルネサスエレクトロニクス	46.1	64	131,392	
セイコーエプソン	9.1	10.8	30,142	
ワコム	5.4	—	—	
アルバック	1.7	1.8	13,089	
エレコム	1.7	—	—	
パナソニックホールディングス	83.5	99.3	126,706	
アンリツ	5	—	—	
ソニーグループ	19	124	336,040	
TDK	11.2	66.5	119,600	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
メイコー	—	0.8	4,928	
ヒロセ電機	1.1	1.2	22,266	
横河電機	7.7	9.2	32,945	
アズビル	4.9	22.8	27,861	
日本光電工業	3.2	6.9	15,252	
堀場製作所	1.3	1.6	15,092	
アドバンテスト	22.1	23.8	194,707	
キーエンス	3.6	4.8	321,072	
シスメックス	6	21.5	61,963	
フェローテックホールディングス	2.1	2.6	6,773	
レーザータック	3.2	3.8	82,631	
日本電子	1.8	2.1	11,713	
ファナック	34.1	40.3	159,507	
ローム	12.9	15.1	25,821	
浜松ホトニクス	5.6	13.4	26,833	
三井ハイテック	0.7	3.7	3,255	
新光電気工業	2.5	2.9	15,674	
京セラ	10.9	51.7	87,812	
太陽誘電	3.4	4.1	11,715	
村田製作所	63.7	74.3	210,194	
小糸製作所	8.4	8.6	17,286	
SCREENホールディングス	2.4	2.8	27,524	
キヤノン	—	41.5	208,413	
東京エレクトロン	12	9.7	230,084	
輸送用機器 (5.6%)				
トヨタ紡織	2.9	3.5	6,685	
豊田自動織機	5.1	7.1	78,455	
デンソー	57.8	68.6	142,928	
三菱ロジスネクスト	—	1.3	1,539	
いすゞ自動車	20.4	23.4	45,992	
トヨタ自動車	106.6	102.8	261,266	
三菱自動車工業	—	32.5	13,126	
カヤバ	0.7	0.8	3,876	
アイシン	5.4	17.6	28,133	
マツダ	23.2	27.5	28,998	
本田技研工業	170.1	196.6	299,913	
スズキ	12.9	61.1	91,986	
SUBARU	22.1	25.8	67,376	
ヤマハ発動機	10.1	35.1	47,507	
豊田合成	2	2.4	6,133	
シマノ	2.8	3.6	87,804	
精密機器 (3.3%)				
テルモ	21.5	46.4	136,648	
島津製作所	8.5	11.1	51,470	
ナカニシ	3	3.5	9,145	
東京精密	1.5	1.7	13,409	
オリンパス	43.1	47.6	134,969	
HOYA	14.4	16.4	333,412	
ノーリツ鋼機	—	0.8	3,192	
朝日インテック	7.8	10.1	25,169	
シチズン時計	—	7.7	7,184	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
その他製品 (2.5%)				
三井松島ホールディングス	—	0.7	3,199	
フルヤ金属	—	0.8	3,148	
パンダイナムコホールディングス	19.2	22.6	72,184	
パイロットコーポレーション	1	1.3	6,115	
大日本印刷	—	17.2	44,582	
アシックス	—	30.7	83,718	
ローランド	—	0.6	2,364	
ヤマハ	4.4	15.2	19,098	
ビジョン	4.5	—	—	
任天堂	37.6	39.5	318,014	
電気・ガス業 (1.3%)				
中部電力	25.8	30.7	52,174	
関西電力	27	32.1	81,566	
九州電力	—	19.2	31,507	
電源開発	5.3	6.8	16,479	
イーレックス	1.2	—	—	
レノバ	1.9	—	—	
東京瓦斯	14.8	16.2	51,888	
大阪瓦斯	14.2	16.6	52,804	
陸運業 (1.3%)				
SBSホールディングス	0.6	0.7	1,802	
京浜急行電鉄	—	10.3	12,303	
小田急電鉄	—	13.8	21,983	
東海旅客鉄道	—	32	102,016	
西武ホールディングス	—	10.1	33,299	
近鉄グループホールディングス	—	8.3	29,896	
ヤマトホールディングス	8.9	10.1	16,422	
山九	1.8	2	9,712	
センコーグループホールディングス	3.7	4.4	5,966	
AZ-COM丸和ホールディングス	1.7	2.1	2,249	
SGホールディングス	13.4	13.9	20,975	
NIPPON EXPRESSホールディングス	2.4	3.1	23,662	
海運業 (1.1%)				
日本郵船	18.7	21.5	112,617	
商船三井	12.3	18	90,990	
川崎汽船	5.3	18.9	40,842	
NSユナイテッド海運	0.4	0.4	1,848	
飯野海運	—	3	3,834	
倉庫・運輸関連業 (0.0%)				
三井倉庫ホールディングス	0.7	0.8	5,488	
情報・通信業 (7.5%)				
NECネットエスアイ	2.3	3.3	8,853	
システナ	11.8	12.6	4,662	
日鉄ソリューションズ	1.2	2.8	9,996	
TIS	7.7	8.8	33,000	
コーエーテックモホールディングス	4.4	5.2	8,164	
ネクソン	15.7	18.3	48,110	
SHIFT	0.5	0.6	8,763	
ティーガイア	0.7	—	—	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1.8	2.1	7,100	
GMOペイメントゲートウェイ	1.4	1.9	17,424	
インターネットイニシアティブ	3.8	4	11,782	
ラクス	3.3	3.9	8,217	
チェンジホールディングス	1.7	—	—	
ビジョナル	—	1	8,080	
野村総合研究所	14	18.1	90,481	
オービック	2.3	13.9	67,345	
ジャストシステム	1	1.2	4,152	
LINEヤフー	99.9	118.8	50,834	
トレンドマイクロ	3.3	4.4	35,455	
日本オラクル	1.3	1.6	24,416	
フューチャー	—	2.1	3,706	
大塚商会	3.5	9.5	32,632	
電通総研	0.9	0.8	4,352	
東映アニメーション	0.3	2	6,260	
デジタルガレージ	1.2	—	—	
ネットワンシステムズ	2.6	3.2	11,177	
BIPROGY	2.6	2.5	12,067	
U-NEXT HOLDINGS	0.8	0.9	4,450	
日本電信電話	1,443.4	2,227.8	324,590	
KDDI	54.3	61.3	290,500	
ソフトバンク	112.9	1,334	249,858	
光通信	0.8	0.8	25,080	
GMOインターネットグループ	2.6	2.7	6,947	
KADOKAWA	3.7	—	—	
東宝	4.4	4.6	26,799	
NTTデータグループ	22	21.8	52,625	
DTS	1.5	—	—	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3.5	3.8	22,363	
カブコン	7	14.9	48,842	
SCSK	5.7	5.8	16,683	
NSD	2.5	2.9	9,468	
コナミグループ	3	3.1	43,431	
ソフトバンクグループ	34.6	—	—	
卸売業(7.2%)				
東京エレクトロン デバイス	—	0.9	3,195	
双日	7.4	9.8	32,673	
アルフレッサ ホールディングス	7.4	—	—	
神戸物産	5.7	6.8	28,451	
ダイワボウホールディングス	3	3.9	10,881	
マクニカホールディングス	1.8	6.2	12,269	
シップヘルスケアホールディングス	2.7	3.2	7,524	
メディアパルホールディングス	7.1	9	22,774	
IDOM	2.2	2.3	2,950	
伊藤忠商事	43.3	43.1	326,353	
丸紅	57.3	73	174,798	
豊田通商	6.5	23.1	61,342	
兼松	2.9	3.7	8,687	
三井物産	44.8	92.6	291,227	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
住友商事	44.8	52.7	172,961	
三菱商事	35.5	107.4	305,016	
キャノンマーケティングジャパン	1.7	2	9,320	
阪和興業	1.3	1.6	8,208	
岩谷産業	1.7	8	16,184	
稲畑産業	1.5	1.7	5,593	
伊藤忠エネクス	1.8	2.2	3,429	
サンリオ	—	7.1	29,081	
加賀電子	0.6	1.6	4,553	
PALTA C	1.2	—	—	
ミスミグループ本社	11.2	13.3	33,961	
小売業(4.5%)				
ローソン	1.8	—	—	
エービーシー・マート	3.2	3.9	11,941	
アスクル	1.5	2.1	4,227	
アダストリア	—	1.1	4,328	
日本マクドナルドホールディングス	4.5	5.4	35,586	
バルグループホールディングス	—	1.7	5,474	
セリア	2	2.6	8,632	
MonotaRO	10.5	12.5	30,718	
マツキヨココカラ&カンパニー	13.5	16	33,536	
ZOZO	4.9	5.6	30,139	
ウエルシアホールディングス	3.8	4.6	9,022	
クリエイトSDホールディングス	1.2	1.2	3,744	
ネクステージ	1.7	2	2,886	
コスモス薬品	0.7	1.5	11,770	
セブン&アイ・ホールディングス	25.5	89.1	199,361	
ツルハホールディングス	1.6	1.8	15,816	
クスリのアオキホールディングス	0.7	2.9	9,581	
FOOD & LIFE COMPANIES	4	4.7	14,071	
ノジマ	2	2.6	5,311	
良品計画	8.1	10.5	26,460	
コーナン商事	1	—	—	
バン・パシフィック・インター ナショナルホールディングス	15	17.8	67,088	
ゼンショーホールディングス	4.1	4.5	34,996	
ワークマン	0.9	1	4,240	
VTホールディングス	2.8	—	—	
スギホールディングス	1.5	5.3	14,204	
日本瓦斯	3.9	4.6	10,074	
ライフコーポレーション	0.6	0.9	2,992	
コメリ	1.2	—	—	
しまむら	0.9	2.1	17,482	
丸井グループ	—	5.8	13,937	
イズミ	1.1	—	—	
ヤオコー	0.8	1	9,371	
ケーズホールディングス	5.2	—	—	
ニトリホールディングス	3	3.2	66,736	
ファーストリテイリング	3.3	5	265,600	
サンドラッグ	2.8	3	11,793	

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
銀行業 (5.7%)			
めぶきフィナンシャルグループ	34.2	38	22,123
コンコディア・フィナンシャルグループ	37	43.6	34,051
三菱UFJフィナンシャル・グループ	231.1	195.6	315,502
りそなホールディングス	86.6	94	97,149
三井住友トラストグループ	12.4	29.2	99,221
三井住友フィナンシャルグループ	38.9	93.9	300,667
千葉銀行	19.2	22.8	26,185
ふくおかフィナンシャルグループ	5.5	7.1	25,616
セブン銀行	24.7	25.7	7,979
みずほフィナンシャルグループ	99.7	100.7	320,226
証券・商品先物取引業 (1.1%)			
F P G	—	2.9	7,168
S B I ホールディングス	10	13.2	44,536
ジャフコ グループ	2.3	—	—
大和証券グループ本社	49.3	63.5	66,833
野村ホールディングス	124.2	137.8	109,137
マネックスグループ	7.4	8	5,336
保険業 (3.6%)			
SOMPOホールディングス	11.8	37	121,804
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	14	55	192,885
第一生命ホールディングス	33.7	38.5	148,918
東京海上ホールディングス	68.2	56.3	318,376
その他金融業 (1.6%)			
全国保証	1.8	2.1	11,762
クレディセブン	—	5.2	18,350
芙蓉総合リース	0.6	0.8	8,700
みずほリース	1	6.9	6,906
東京センチュリー	1.3	6.1	9,714
イオンフィナンシャルサービス	4	4.7	5,738
アコム	12.3	14.6	5,378
ジャックス	0.7	0.9	3,483
オリエントコーポレーション	1.8	—	—
オリックス	45.3	49.1	160,311
三菱HCキャピタル	26.9	36.5	36,682
日本取引所グループ	19.4	42.2	77,015
不動産業 (2.3%)			
大東建託	2.5	3	50,175
ヒューリック	16.1	19.1	27,150
野村不動産ホールディングス	4.3	4.6	17,383
プレサンスコーポレーション	1.1	—	—
オープンハウスグループ	2.5	3	17,334
東急不動産ホールディングス	20.7	24.6	24,235
飯田グループホールディングス	5.9	7.9	17,648
ケイアイスター不動産	0.3	0.4	1,580
三井不動産	29.4	113.6	153,814
三菱地所	41.6	51.4	120,019
東京建物	6	7.2	17,218
住友不動産	12.5	11.8	55,318

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)		
スターツコーポレーション	1	1.2	4,266	
レイサム	—	0.4	2,360	
カチタス	1.9	2.2	4,314	
サービス業 (4.1%)				
ジェイエイシーリクルートメント	—	3.1	2,290	
日本M&Aセンターホールディングス	12.3	13.6	8,358	
U T グループ	1.1	1.1	2,932	
パソナグループ	0.9	1	2,009	
エス・エム・エス	2.8	3	6,465	
パーソルホールディングス	79.4	87.1	22,611	
総合警備保障	13.4	14.3	14,779	
カカココム	5.3	5.6	13,641	
ディップ	1.3	1.3	3,372	
ベネフィット・ワン	3.3	—	—	
エムスリー	14.2	16.9	29,752	
博報堂DYホールディングス	9.2	10.9	13,189	
H. U. グループホールディングス	2.1	—	—	
オリエンタルランド	—	45.3	163,487	
ラウンドワン	—	8.1	7,970	
ビー・エム・エル	0.9	1.1	2,984	
ユー・エス・エス	7.4	19.2	24,038	
サイバーエージェント	15.9	18.9	19,533	
フルキャストホールディングス	0.7	—	—	
テクノプロ・ホールディングス	4.3	5	14,015	
ジャパンマテリアル	2.2	2.6	4,846	
リクルートホールディングス	53.3	39.3	380,306	
ベルシステム24ホールディングス	1	0.9	1,186	
ペイカレント	5.7	6.3	31,726	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	2.6	2.8	8,722	
アンビスホールディングス	—	1.8	3,517	
リロググループ	4	—	—	
トランス・コスモス	0.9	1	3,440	
セコム	7.3	17.4	91,872	
メイテックグループホールディングス	2.8	2.9	9,274	
イオンディライト	0.8	0.9	3,861	
合 計	株 数・金 額 銘柄数<比率>	6,694 399	10,812 400	21,772,416 <98.1%>

(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 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 J P X 日経400	345	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 21,772,416	% 98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	438,747	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	22,211,163	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	22,210,053,922円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	146,492,416
株 式(評価額)	21,772,416,380
未 収 入 金	54,597,892
未 収 配 当 金	217,419,404
未 収 利 息	866
差 入 委 託 証 拠 金	19,126,964
(B)負 債	10,663,746
未 払 金	146,736
未 払 解 約 金	10,517,010
(C)純 資 産 総 額(A-B)	22,199,390,176
元 本	8,192,685,367
次 期 繰 越 損 益 金	14,006,704,809
(D)受 益 権 総 口 数	8,192,685,367口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,097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	536,826,171円
受 取 配 当 金	471,662,858
受 取 利 息	182,245
そ の 他 収 益 金	64,990,879
支 払 利 息	△9,811
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	3,087,933,488
売 買 益	3,760,587,803
売 買 損	△672,654,315
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	51,071,612
取 引 益	96,734,541
取 引 損	△45,662,929
(D)そ の 他 費 用	△3,944,972
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	3,671,886,299
(F)前 期 繰 越 損 益 金	8,806,574,823
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	5,242,958,287
(H)解 約 差 損 益 金	△3,714,714,600
(I) 計 (E+F+G+H)	14,006,704,809
次 期 繰 越 損 益 金(I)	14,006,704,809

(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ものを含みます。

(注2) (G)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) (H)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7,417,119,080円、期中追加設定元本額は2,985,871,085円、期中一部解約元本額は2,210,304,798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日経インデックス400・オープン	5,229,645,394円
JPX日経400オープン(適格機関投資家専用)	2,963,039,973円

お知らせ

株式会社東芝の株式について、同社による有価証券報告書等の虚偽記載により親投資信託が被った損失の回復を図るため、2017年3月に損害賠償請求の訴訟を提起していましたが、和解が成立し、64,990,057円の支払いを受けました。

(和解金支払日:2023年12月22日)