

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12期(決算日 2023年4月20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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
第8期(2021年4月20日)	12,898	0	13.7	13,150	13.6	97.5	2.2	87
第9期(2021年10月20日)	13,732	0	6.5	13,987	6.4	97.5	2.0	101
第10期(2022年4月20日)	12,343	0	△10.1	12,585	△10.0	97.9	1.9	100
第11期(2022年10月20日)	12,646	0	2.5	12,966	3.0	97.3	1.8	106
第12期(2023年4月20日)	13,256	0	4.8	13,626	5.1	97.8	1.9	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「買建比率－売建比率」で算出しております。

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	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
(当期首) 2022年10月20日	円 12,646	% —		% —	% 97.3	% 1.8
10月末	12,918	2.2	13,244	2.1	96.8	1.8
11月末	13,206	4.4	13,553	4.5	97.6	1.7
12月末	12,731	0.7	13,064	0.8	97.9	1.8
2023年1月末	13,189	4.3	13,535	4.4	97.9	1.8
2月末	13,129	3.8	13,485	4.0	98.1	1.8
3月末	13,264	4.9	13,631	5.1	97.5	1.8
(当期末) 2023年4月20日	13,256	4.8	13,626	5.1	97.8	1.9

(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。

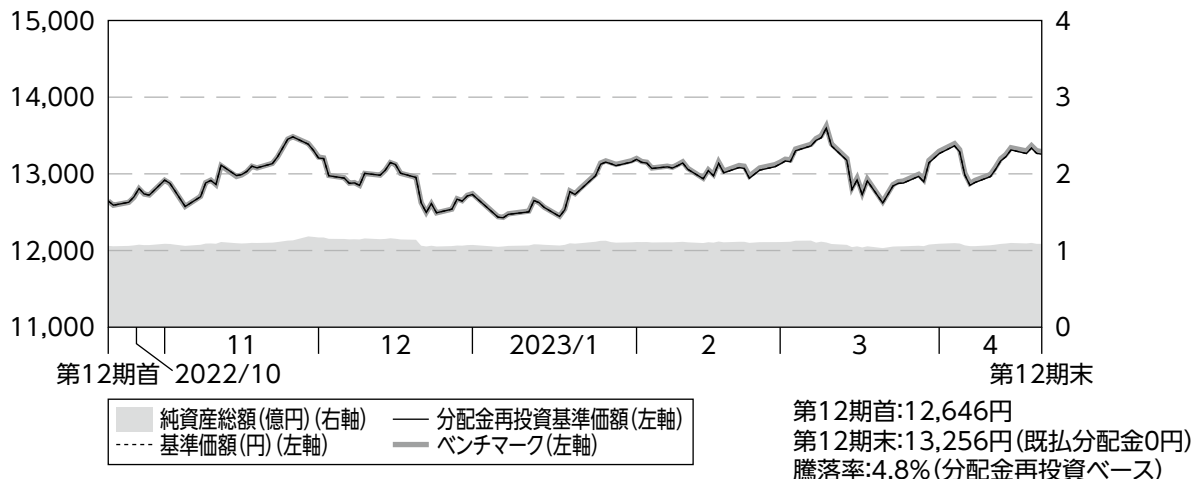
(注3) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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(以下、「日経」という。)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株価指数です。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。)及び日経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。

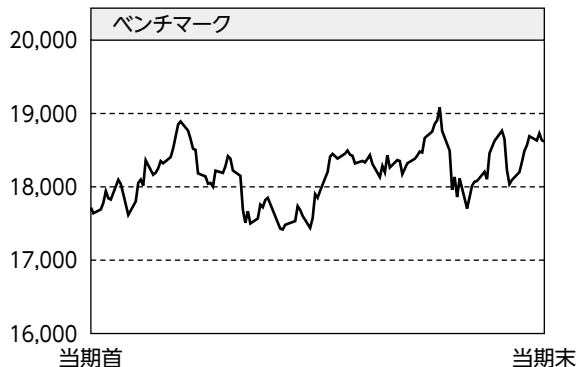
(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022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。インフレのピークアウト観測を背景にFRB(米連邦準備理事会)が利上げペースを緩めるとの見方などから、国内株式市場は2022年11月にかけて上昇しました。その後は、日銀による長期金利の許容変動幅が拡大されたことが事実上の利上げと解釈され下落しましたが、次期日銀総裁候補である植田和男氏が金融緩和継続の方針を示したことや引き続き円安・米ドル高が進行したことが好感され、2023年3月上旬にかけて堅調に推移しました。期末では、米国での銀行の経営破綻をきっかけに市場心理が悪化したことなどから一時急落したものの、各国当局の迅速な対応を受けて欧米の金融システム不安に対しての過度な懸念が後退したことなどから反発しました。

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、資金の効率的な運用を行う目的で、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、JPX日経中小型株指数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。

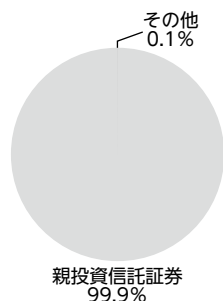
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

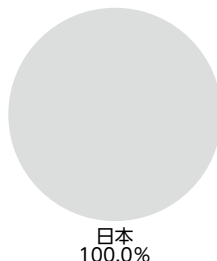
	当期末
	2023年4月20日
JPX日経中小型株インデックスマザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

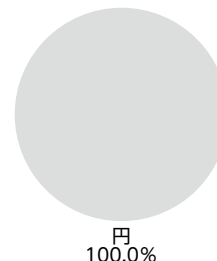
○資産別配分



○国別配分



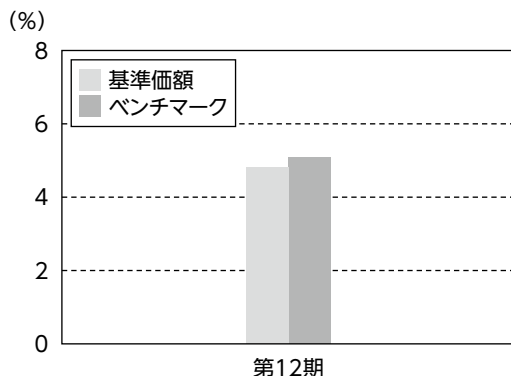
○通貨別配分



(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)などによるものです。

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12期	
	2022年10月21日~2023年4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	(円)	4,700

(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
	(2022年10月21日~2023年4月20日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	29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13,072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)	(13)	(0.099)	
(販売会社)	(13)	(0.099)	
(受託会社)	(3)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	1	0.007	(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)	(1)	(0.007)	
(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＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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	0	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)	(0)	(0.003)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	30	0.229	

(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。

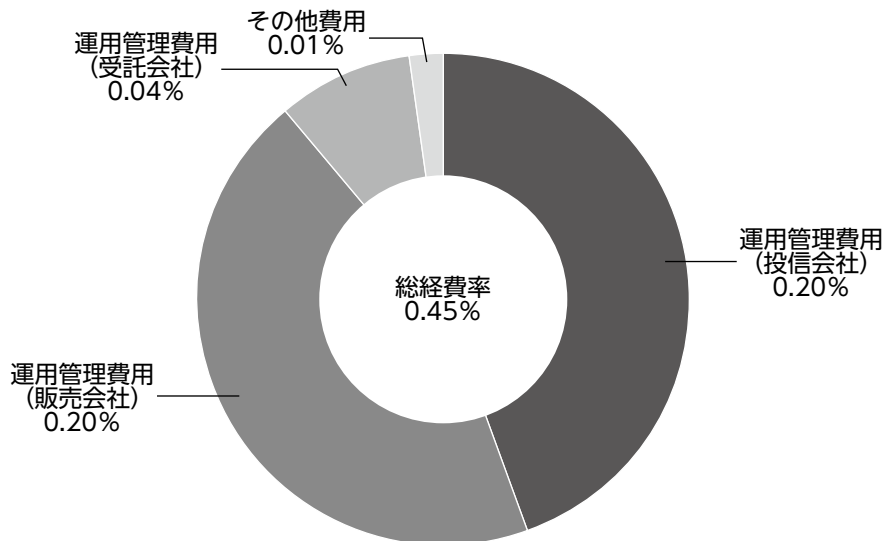
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.45%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
	千口	千円	千口	千円
JPX日経中小型株インデックス マザーファンド	11,865	15,953	13,863	18,635

株式売買比率

■親投資信託の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) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	42,566千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	108,052千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.39

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	0.000007	0.000007	100.0	0.000007	0.000007	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	35	3	8.6	35	3	8.6

(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	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	0.000193	0.000193	100.0	0.000193	0.000193	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	287	24	8.4	288	24	8.3

<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 >

	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	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	千口 81,924	千口 79,926	千円 108,652

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、79,926千口です。

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 108,652	% 98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,190	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	109,842	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 2023年4月20日現在
(A)資 産	109,842,168円
コール・ローン等	533,096
JPX日経中小型株インデックス マザーファンド(評価額)	108,652,460
未 収 入 金	656,612
(B)負 債	1,135,312
未 払 解 約 金	892,353
未 払 信 託 報 酬	240,020
そ の 他 未 払 費 用	2,939
(C)純 資 産 総 額(A-B)	108,706,856
元 本	82,004,071
次 期 繰 越 損 益 金	26,702,785
(D)受 益 権 総 口 数	82,004,071口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,256円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年10月21日 至 2023年 4月20日
(A)配 当 等 収 益	△8円
支 払 利 息	△8
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	4,587,662
売 買 益	5,372,829
売 買 損	△785,167
(C)信 託 報 酬 等	△242,959
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	4,344,695
(E)前 期 繰 越 損 益 金	5,495,753
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	16,862,337
(配 当 等 相 当 額)	(24,407,066)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△7,544,729)
(G) 計 (D+E+F)	26,702,785
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	26,702,785
追 加 信 託 差 損 益 金	16,862,337
(配 当 等 相 当 額)	(24,451,404)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△7,589,067)
分 配 準 備 積 立 金	14,094,294
繰 越 損 益 金	△4,253,846

- (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83,868,665円、期中追加設定元本額は15,811,527円、期中一部解約元本額は17,676,121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)	1,565,523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)	－円
(C) 収益調整金額	24,451,404円
(D) 分配準備積立金額	12,528,771円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	38,545,698円
(F) 期末残存口数	82,004,071口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	4,700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日経中小型株インデックスマザーファンド

運用報告書

第6期（決算日 2022年10月20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		株式先物比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第2期(2018年10月22日)	10,941	0.6%	11,007	1.1%	98.7%	138
第3期(2019年10月21日)	10,838	△0.9	10,952	△0.5	97.0	116
第4期(2020年10月20日)	11,510	6.2	11,580	5.7	97.9	91
第5期(2021年10月20日)	13,990	21.5	13,987	20.8	97.6	101
第6期(2022年10月20日)	12,940	△7.5	12,966	△7.3	97.4	106

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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(以下、「日経」という。)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株価指数です。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。)及び日経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

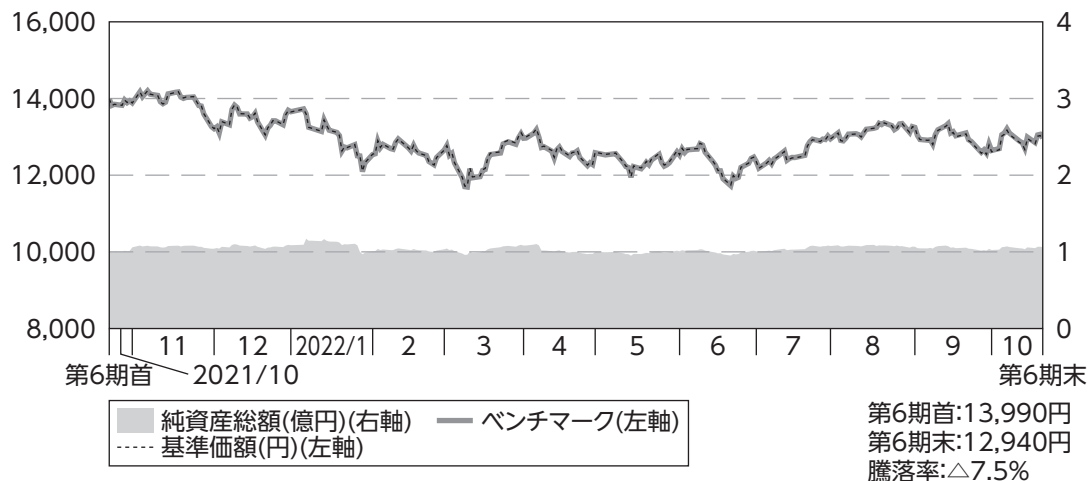
年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組入比率	株式先物 比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(当 期 首) 2021年10月20日	円 13,990	% ー	13,987	% ー	% 97.6	% 2.0
10月末	13,883	△0.8	13,882	△0.7	97.6	1.9
11月末	13,214	△5.5	13,208	△5.6	97.9	1.8
12月末	13,649	△2.4	13,652	△2.4	98.0	1.8
2022年 1月末	12,549	△10.3	12,537	△10.4	97.9	1.9
2月末	12,654	△9.5	12,654	△9.5	97.9	1.8
3月末	12,993	△7.1	12,960	△7.3	97.9	1.8
4月末	12,600	△9.9	12,583	△10.0	97.8	1.9
5月末	12,534	△10.4	12,521	△10.5	97.8	1.9
6月末	12,352	△11.7	12,352	△11.7	97.8	1.9
7月末	12,943	△7.5	12,946	△7.4	97.8	1.8
8月末	13,244	△5.3	13,243	△5.3	97.9	1.8
9月末	12,610	△9.9	12,641	△9.6	97.3	1.8
(当 期 末) 2022年10月20日	12,940	△7.5	12,966	△7.3	97.4	1.8

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は「買建比率ー売建比率」で算出しております。

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)ベンチマークは、2021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。

新型コロナウイルス・オミクロン株の感染拡大、米国の金融引き締め早期進行懸念、ウクライナを巡る地政学リスクなどが重荷となり、2022年3月にかけて国内株式市場は下落基調が続きました。その後は、ウクライナとロシアの停戦協定への進展期待や、FOMC（米連邦公開市場委員会）で決定された利上げが想定内の範囲内であったことなどが好感され急反発しました。期末にかけては、円安・米ドル高の進行などが下支えになった一方で、欧米の金融引き締め加速が警戒されたことなどから、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

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、資金の効率的な運用を行う目的で、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、JPX日経中小型株指数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

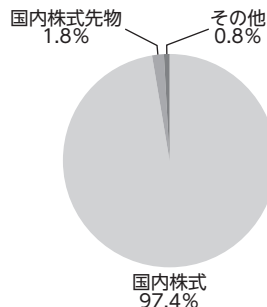
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ミニTOPIX先物 2212	日本	1.8%
2	兼松	日本	1.4%
3	コメダホールディングス	日本	1.4%
4	デジタルアーツ	日本	1.2%
5	船井総研ホールディングス	日本	1.2%
6	高砂熟学工業	日本	1.2%

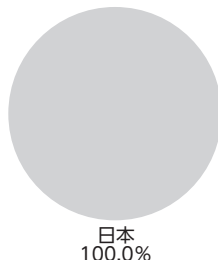
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	エン・ジャパン	日本	1.2%
8	マネックスグループ	日本	1.1%
9	竹内製作所	日本	1.1%
10	ワコム	日本	1.1%
組入銘柄数		196	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

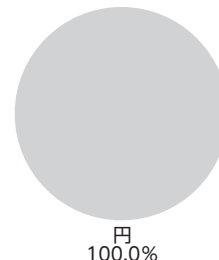
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

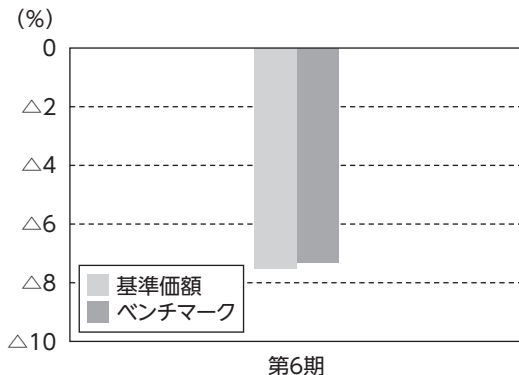


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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1.8%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。

差異の主な要因はファンドとベンチマークの個別銘柄保有比率の較差などによるものです。

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
	(2021年10月21日~2022年10月20日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	2円	0.016%	(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)	(2)	(0.016)	
(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)	
(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	-	-	(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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	2	0.016	

(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(12,935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 45 (0.26)	千円 71,409 (-)	千株 41	千円 56,287

(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 7	百万円 7	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) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	127,696千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	101,784千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.25

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

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			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 512	百万円 26	% 5.1	百万円 512	百万円 25	% 4.9

(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	当期中(前期末)	当 期 末		評 価 額 (千円)	銘柄	当期中(前期末)	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)			株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	
建設業(6.7%)					昭和電線ホールディングス	0.2	0.3	541	
ヒノキヤグループ	0.1	—	—		金属製品(2.5%)				
タマホーム	0.2	0.2	454		宮地エンジニアリンググループ	0.1	0.1	325	
東急建設	1	—	—		トーカロ	0.6	0.7	800	
ビーアールホールディングス	0.4	—	—		RS Technologies	0.1	0.1	634	
東建コーポレーション	0.1	0.1	796		横河ブリッジホールディングス	0.4	0.4	783	
オリエンタル白石	1.1	1.3	334		機械(6.4%)				
飛鳥建設	0.2	—	—		ツガミ	0.5	0.6	698	
三井住友建設	1.9	—	—		オプトラン	0.3	0.4	838	
大豊建設	0.2	—	—		野村マイクロ・サイエンス	0.1	0.1	320	
東鉄工業	0.3	0.4	989		日精イー・エス・ビー機械	0.1	0.1	396	
浅沼組	0.1	—	—		澁谷工業	0.2	0.2	503	
ビーエス三菱	0.3	0.3	183		オルガノ	0.1	0.4	846	
東洋建設	0.9	1	903		キトー	0.2	0.2	544	
世紀東急工業	0.4	—	—		フクシマガリレイ	0.2	0.2	813	
ライト工業	0.4	0.5	1,000		竹内製作所	0.4	0.4	1,142	
住友電設	0.2	0.2	527		新晃工業	0.2	0.3	474	
高砂熱学工業	0.7	0.7	1,253		ツバキ・ナカシマ	0.5	—	—	
レイズネクスト	0.4	0.4	489		電気機器(5.8%)				
食料品(1.3%)					ヤーマン	0.4	0.5	556	
S F o o d s	—	0.3	822		MCJ	0.8	1	922	
ファーマフーズ	—	0.4	500		メルコホールディングス	—	0.1	298	
化学(4.6%)					ワコム	1.8	1.8	1,130	
北の達人コーポレーション	0.9	1	272		メイコー	0.2	0.3	752	
関東電化工業	0.6	0.5	465		ホシデン	0.6	0.6	906	
田岡化学工業	0.1	0.1	85		メガチップス	0.2	0.3	735	
KHネオケム	0.4	0.4	1,088		OBARA GROUP	0.1	0.1	337	
タキロンシーアイ	0.5	—	—		山一電機	—	0.2	394	
扶桑化学工業	0.2	0.2	625		市光工業	0.3	—	—	
トリケミカル研究所	0.2	0.3	591		精密機器(0.4%)				
新日本製薬	—	0.1	147		ブイ・テクノロジー	0.1	0.1	270	
東洋合成工業	0.1	0.1	677		インターアクション	0.1	0.1	142	
JCU	0.3	0.3	841		その他製品(1.2%)				
医薬品(1.9%)					トランザクション	0.1	—	—	
栄研化学	—	0.4	722		ニホンフラッシュ	0.2	—	—	
東和薬品	0.3	0.4	870		フルヤ金属	—	0.1	759	
大幸薬品	0.4	—	—		SHOEI	0.3	—	—	
ミズホメディー	—	0.1	313		タカラトミー	1.1	—	—	
ガラス・土石製品(1.5%)					グローブライド	—	0.2	437	
日本カーボン	0.1	0.1	413		電気・ガス業(1.6%)				
ニチハ	0.3	0.4	1,088		北海道電力	2.3	2.5	1,087	
鉄鋼(0.5%)					エフオン	0.1	—	—	
日本冶金工業	0.2	0.2	562		メタウォーター	0.3	0.3	566	
非鉄金属(1.0%)					陸運業(1.6%)				
大紀アルミニウム工業所	0.4	0.4	508		SBSホールディングス	0.2	0.2	578	

銘柄	当期首(前期末)		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
ハマキョウレックス	0.2	0.2	646
サカイ引越センター	0.1	0.1	465
海運業(0.7%)			
N Sユナイテッド海運	—	0.1	389
乾汽船	—	0.2	367
倉庫・運輸関連業(1.7%)			
トランコム	0.1	0.1	818
三井倉庫ホールディングス	0.2	0.3	978
情報・通信業(13.5%)			
デジタルアーツ	0.1	0.2	1,316
ソフトクリエイトホールディングス	—	0.1	321
ブレインパッド	0.1	0.2	182
ポルトゥウィンホールディングス	0.3	0.4	369
エイチーム	0.2	—	—
エニグモ	0.2	0.3	164
ブロードリーフ	1.2	1.4	722
デジタルハーツホールディングス	0.1	0.1	192
システム情報	0.2	—	—
フィックスターズ	0.3	0.3	316
ティーガイア	0.3	0.3	499
テクマトリックス	0.4	0.5	857
ドリコム	—	0.2	178
アバントグループ	0.3	0.3	453
コムチュア	0.2	0.3	717
アステリア	—	0.2	164
アイル	—	0.1	182
マークラインズ	0.1	0.1	255
モバイルファクトリー	0.1	—	—
デジタルインフォメーションテクノロジー	0.1	0.1	168
P R T I M E S	0.1	0.1	227
ダブルスタンダード	0.1	0.1	248
アカツキ	0.1	0.1	205
カナミックネットワーク	0.3	—	—
オロ	—	0.1	145
UUUM	0.1	0.2	200
プロトコーポレーション	0.3	0.3	334
I P S	0.1	0.1	307
ヒトコミュニケーションズホールディングス	0.1	0.1	163
クレスコ	0.2	0.2	344
フューチャー	0.2	0.6	985
S B テクノロジー	—	0.1	221
サイボウズ	0.3	0.3	502
オリコン	0.1	—	—
アルゴグラフィックス	0.2	0.2	784
マーベラス	0.4	—	—
兼松エレクトロニクス	0.1	0.2	839
USEN-NEXT HOLDINGS	0.2	0.2	450
コネクシオ	0.1	—	—
沖縄セルラー電話	0.1	—	—

銘柄	当期首(前期末)		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
ファイバーゲート	0.1	0.1	91
D T S	0.5	—	—
福井コンピュータホールディングス	0.1	0.1	351
ミロク情報サービス	0.2	0.3	440
卸売業(8.8%)			
東京エレクトロン デバイス	—	0.1	565
あい ホールディングス	0.3	0.4	864
グリムス	0.1	0.1	164
コメダホールディングス	0.5	0.6	1,468
日本ライフライン	0.8	0.8	798
I D O M	—	0.9	669
兼松	1	1	1,485
山善	0.9	1	908
ユアサ商事	0.2	0.2	738
伊藤忠エネクス	0.5	0.6	630
加賀電子	0.2	0.2	812
日鉄物産	0.2	—	—
小売業(8.4%)			
ハローズ	0.1	0.2	606
ジンズホールディングス	—	0.1	438
アークランドサービスホールディングス	0.2	0.2	440
H a m e e	0.1	0.1	89
シュッピン	0.2	0.2	290
オイシックス・ラ・大地	—	0.4	667
日本調剤	0.1	0.2	266
J Mホールディングス	—	0.2	340
アレンザホールディングス	0.2	—	—
G-7ホールディングス	0.2	0.3	462
コジマ	0.4	0.5	316
V Tホールディングス	—	1.1	528
薬王堂ホールディングス	0.1	0.1	271
スクロール	—	0.4	277
アクシアル リテイリング	0.3	0.2	691
Genky DrugStores	0.1	0.1	376
アークランズ	—	0.4	630
日本K F Cホールディングス	—	0.3	820
ベルク	0.2	0.2	1,116
証券・商品先物取引業(2.9%)			
F P G	0.8	0.9	1,055
ジャパソインベストメントアドバイザー	0.2	—	—
GMOフィナンシャルホールディングス	0.4	0.5	355
マネックスグループ	—	2.4	1,159
スパークス・グループ	1.1	0.3	406
その他金融業(2.3%)			
ジェイリース	—	0.1	245
イントラスト	0.1	—	—
日本モーゲージサービス	0.1	—	—
アルヒ	0.4	0.4	558
プレミアグループ	0.1	0.4	627

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
イー・ギャランティ	0.3	0.4	948
不動産業(5.7%)			
日本駐車場開発	2.6	2.8	742
LAホールディングス	—	0.1	307
三栄建築設計	0.1	0.1	155
サムティ	0.3	—	—
ディア・ライフ	0.3	0.4	247
地主	0.2	0.2	405
プレサンスコーポレーション	0.4	0.3	449
JPMC	0.1	—	—
ケイアイスター不動産	0.1	0.1	456
グッドコムアセット	0.1	0.1	166
ジェイ・エス・ビー	—	0.1	392
ロードスターキャピタル	0.1	0.1	172
ウェルス・マネジメント	—	0.1	146
日本エスコン	0.4	0.5	416
MIRARTHホールディングス	1	1.2	474
シノケングループ	0.3	—	—
トーセイ	0.3	0.4	550
サンフロンティア不動産	0.3	0.4	466
FJネクストホールディングス	0.2	0.3	304
サービス業(19.0%)			
ジェイエイシーリクルートメント	0.2	0.2	488
メンバーズ	0.1	0.1	269
UTグループ	—	0.4	873
アイティメディア	—	0.1	170
ケアネット	—	0.5	666
夢真ビーネックスグループ	0.6	—	—
コシダカホールディングス	0.6	—	—
パソナグループ	—	0.3	594
デジタルホールディングス	—	0.2	233
新日本科学	—	0.3	834
ワールドホールディングス	0.1	0.1	261
ジャパンベストレスキューシステム	0.2	—	—
ライク	0.1	0.1	190
エスブルー	0.7	0.7	637
WDBホールディングス	0.1	0.1	244
バリューコマース	0.2	0.2	451
ユナイテッド	0.2	—	—
プレステージ・インターナショナル	0.9	1	633
クイック	—	0.2	386
シーティーエス	0.3	—	—
アルプス技研	0.2	0.2	396

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	
サニックス	0.4	—	—	
りらいあコミュニケーションズ	—	0.4	390	
リソー教育	1.2	1.2	357	
東京個別指導学院	0.2	—	—	
クリーク・アンド・リバー社	—	0.1	201	
フルキャストホールディングス	0.2	0.2	569	
エン・ジャパン	—	0.5	1,242	
Keeper 技研	—	0.2	763	
イー・ガーディアン	0.1	0.1	299	
チャーム・ケア・コーポレーション	0.2	0.2	208	
キャリアリンク	0.1	0.1	241	
I B J	0.2	0.2	196	
M&Aキャピタルパートナーズ	—	0.2	737	
シグマックス・ホールディングス	0.1	0.3	351	
ウィルグループ	0.2	0.2	280	
エラン	0.3	0.3	324	
ベルシステム24ホールディングス	0.4	0.4	563	
ストライク	0.1	0.1	393	
ソラスト	0.6	0.7	622	
インソース	—	0.3	859	
Orchestra Holdings	—	0.1	245	
グレイステクノロジー	0.2	—	—	
ウェルビー	0.1	0.2	194	
ミダックホールディングス	—	0.1	359	
日総工産	0.2	0.2	114	
スプリックス	0.1	0.1	95	
LITALICO	0.2	0.2	558	
カナモト	0.4	0.4	854	
乃村工藝社	1	—	—	
丹青社	0.4	—	—	
船井総研ホールディングス	—	0.5	1,288	
合 計	株 数・金 額	64	69	103,213
	銘柄数<比率>	192	195	<97.4%>

(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	ミニTOPIX	1	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 103,213	% 97.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,932	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	106,145	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 2022年10月20日現在
(A)資 産	106,145,215円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,043,323
株 式(評価額)	103,213,100
未 収 入 金	2,912
未 収 配 当 金	812,380
差 入 委 託 証 拠 金	73,500
(B)負 債	138,108
未 払 金	138,105
未 払 利 息	3
(C)純 資 産 総 額(A-B)	106,007,107
元 本	81,924,200
次 期 繰 越 損 益 金	24,082,907
(D)受 益 権 総 口 数	81,924,200口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,940円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年10月21日 至 2022年10月20日
(A)配 当 等 収 益	2,843,969円
受 取 配 当 金	2,844,353
受 取 利 息	18
そ の 他 収 益 金	285
支 払 利 息	△687
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△11,200,125
売 買 益	7,630,304
売 買 損	△18,830,429
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△86,204
取 引 益	198,736
取 引 損	△284,940
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△8,442,360
(E)前 期 繰 越 損 益 金	29,018,435
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	9,859,667
(G)解 約 差 損 益 金	△6,352,835
(H) 計 (D+E+F+G)	24,082,907
次 期 繰 越 損 益 金(H)	24,082,907

(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) (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72,723,728円、期中追加設定元本額は30,986,831円、期中一部解約元本額は21,786,359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	81,924,200円
--------------------------	-------------

お知らせ

該当事項はありません。