

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15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 (分配落)			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	円	税込 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	%			
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
第13期(2023年10月20日)	13,624	0	2.8	13,952	2.4	97.4	1.8	127
第14期(2024年4月22日)	16,223	0	19.1	16,656	19.4	98.4	1.2	224
第15期(2024年10月21日)	16,796	0	3.5	17,320	4.0	98.3	1.2	224

(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
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首) 2024年4月22日	16,223	—	16,656	—	98.4	1.2
4月末	16,595	2.3	17,034	2.3	98.3	1.2
5月末	16,755	3.3	17,229	3.4	98.5	1.2
6月末	17,277	6.5	17,776	6.7	98.4	1.2
7月末	16,980	4.7	17,476	4.9	97.9	1.3
8月末	16,631	2.5	17,131	2.9	98.7	1.3
9月末	16,778	3.4	17,295	3.8	98.4	1.2
(当期末) 2024年10月21日	16,796	3.5	17,320	4.0	98.3	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「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。

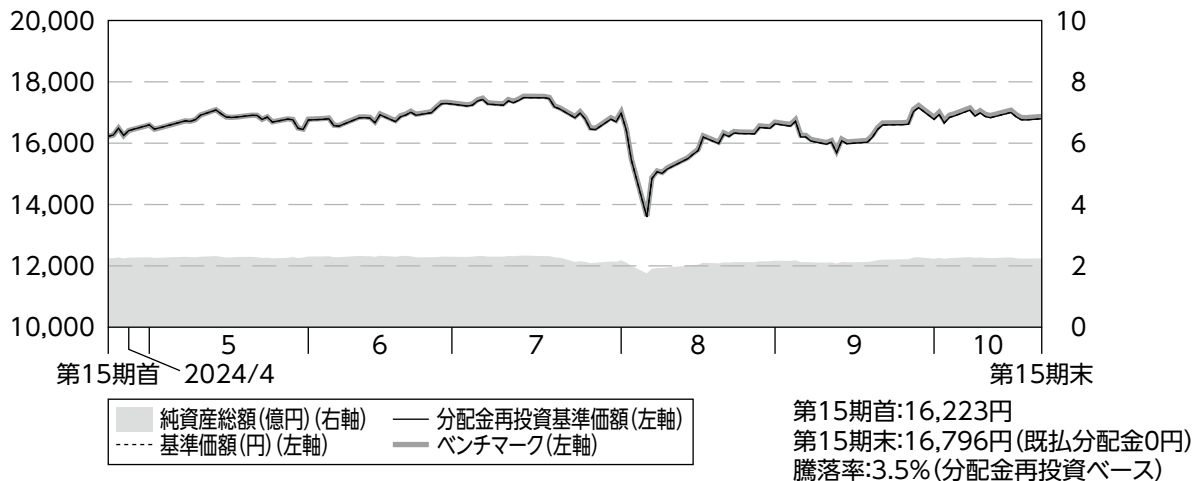
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

【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。

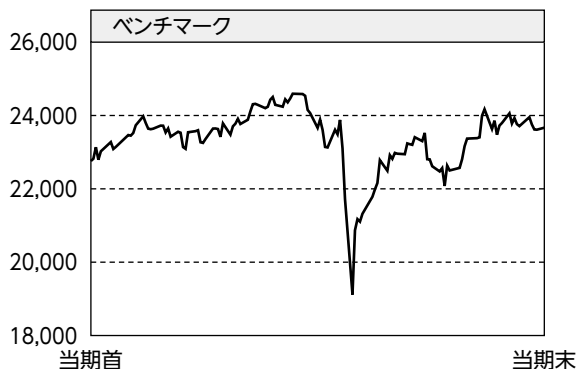
(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(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。

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。

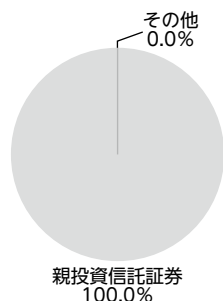
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

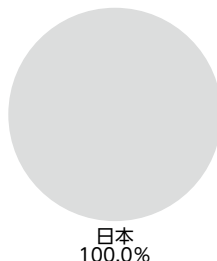
	当期末
	2024年10月21日
JPX日経中小型株インデックスマザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

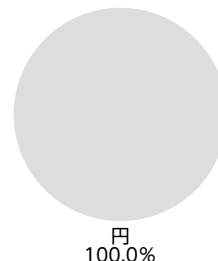
○資産別配分



○国別配分



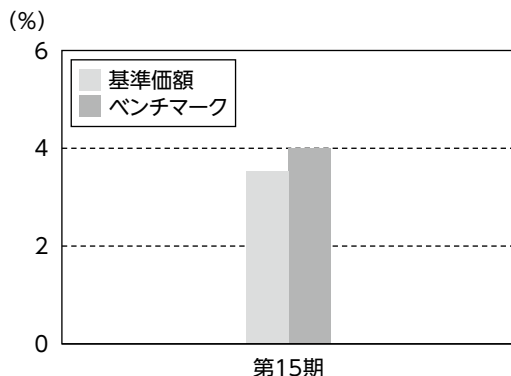
○通貨別配分



(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)およびマザーファンドにおける個別銘柄要因(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15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)	6,795

(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
	(2024年4月23日~2024年10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16,836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	0.013	(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)	(2)	(0.012)	
(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	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	39	0.235	

(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。

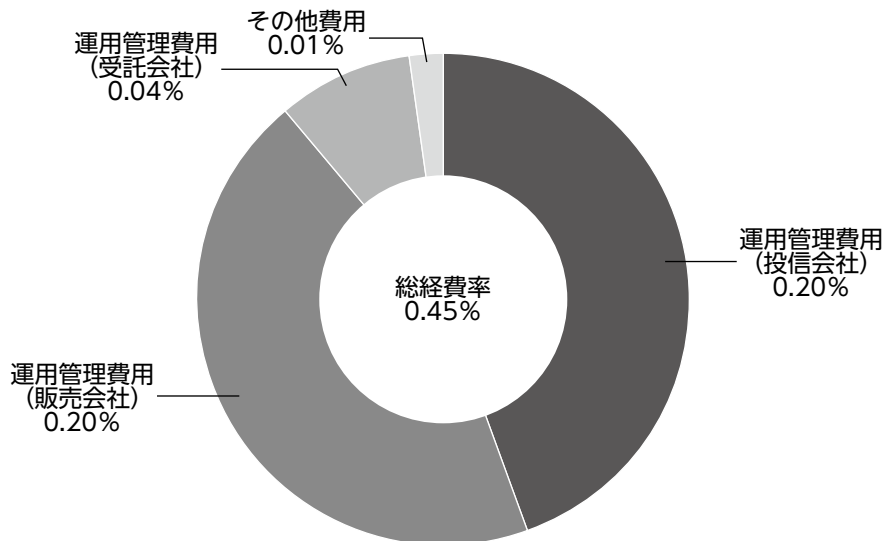
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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
JPX日経中小型株インデックス マザーファンド	千口 16,597	千円 28,189	千口 21,468	千円 37,064

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	172,737千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	220,731千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.78

(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 100	百万円 21	% 21.0	百万円 100	百万円 21	% 21.0

(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
コール・ローン	百万円 456	百万円 96	% 21.1	百万円 459	百万円 96	% 20.9

<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	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 134,230	千口 129,359	千円 224,257

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、129,359千口です。

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 224,257	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	629	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	224,886	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	224,886,913円
コール・ローン等	629,751
JPX日経中小型株インデックス マザーファンド(評価額)	224,257,159
未 収 利 息	3
(B)負 債	517,821
未 払 解 約 金	25,591
未 払 信 託 報 酬	486,216
そ の 他 未 払 費 用	6,014
(C)純 資 産 総 額(A-B)	224,369,092
元 本	133,588,214
次 期 繰 越 損 益 金	90,780,878
(D)受 益 権 総 口 数	133,588,214口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,796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	507円
受 取 利 息	507
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	7,364,723
売 買 益	9,668,897
売 買 損	△2,304,174
(C)信 託 報 酬 等	△492,230
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	6,873,000
(E)前 期 繰 越 損 益 金	17,390,587
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	66,517,291
(配 当 等 相 当 額)	(64,450,493)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,066,798)
(G)計 (D+E+F)	90,780,878
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	90,780,878
追 加 信 託 差 損 益 金	66,517,291
(配 当 等 相 当 額)	(64,549,637)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,967,654)
分 配 準 備 積 立 金	24,263,587

- (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138,321,066円、期中追加設定元本額は28,817,335円、期中一部解約元本額は33,550,187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)	2,514,582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)	4,358,418円
(C) 収益調整金額	66,517,291円
(D) 分配準備積立金額	17,390,587円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	90,780,878円
(F) 期末残存口数	133,588,214口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	6,795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
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率		
第4期(2020年10月20日)	円	%				百万円
	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
第7期(2023年10月20日)	14,001	8.2	13,952	7.6	97.5	127
第8期(2024年10月21日)	17,336	23.8	17,320	24.1	98.3	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

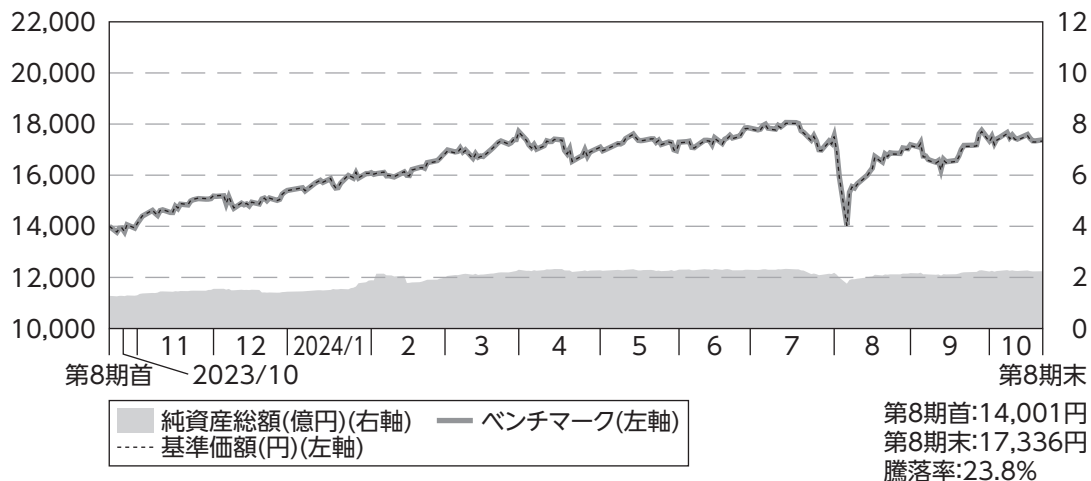
年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組入比率	株式先物 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(当 期 首) 2023年10月20日	円 14,001	% ー	13,952	% ー	% 97.5	% 1.8
10月末	14,106	0.7	14,061	0.8	97.7	1.7
11月末	15,203	8.6	15,129	8.4	98.0	1.5
12月末	15,396	10.0	15,348	10.0	97.9	1.6
2024年 1月末	16,110	15.1	16,042	15.0	98.2	1.4
2月末	16,837	20.3	16,817	20.5	98.0	1.3
3月末	17,683	26.3	17,641	26.4	98.3	1.2
4月末	17,094	22.1	17,034	22.1	98.3	1.2
5月末	17,265	23.3	17,229	23.5	98.5	1.2
6月末	17,809	27.2	17,776	27.4	98.5	1.2
7月末	17,510	25.1	17,476	25.3	98.0	1.3
8月末	17,156	22.5	17,131	22.8	98.7	1.3
9月末	17,314	23.7	17,295	24.0	98.4	1.2
(当 期 末) 2024年10月21日	17,336	23.8	17,320	24.1	98.3	1.2

(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

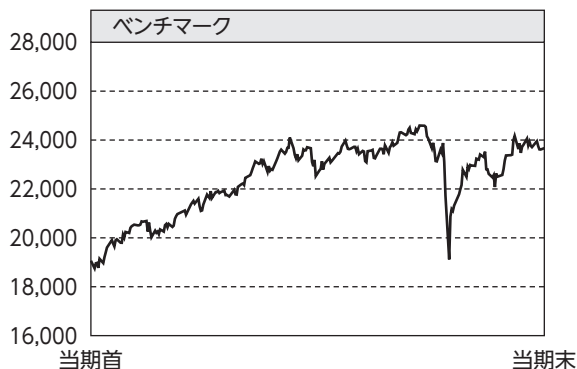


(注)ベンチマークは、2023年10月20日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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

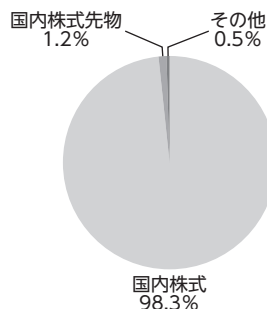
○上位10銘柄

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%

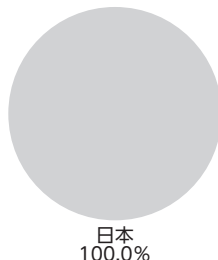
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	物語コーポレーション	日本	1.3%
8	兼松	日本	1.3%
9	SHOEI	日本	1.3%
10	マネックスグループ	日本	1.2%
組入銘柄数		201	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

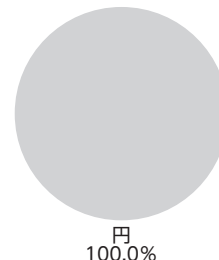
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

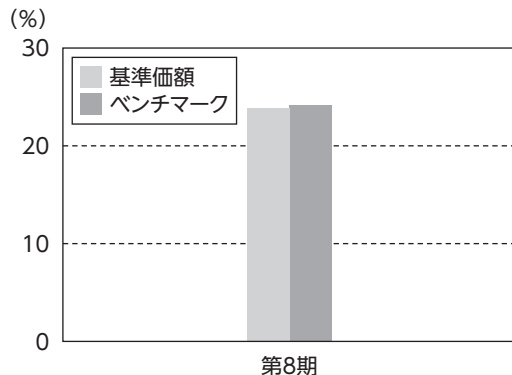


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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
(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 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	- (-) (-) (-)	- (-) (-) (-)	(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、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	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	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			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
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	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(0.2%)			
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 Foods	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	—	—
KH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-ne	—	0.1	175
東洋合成工業	0.1	0.1	723
タカラバイオ	—	1.2	1,260
JCU	0.3	0.5	1,707
クミアイ化学工業	—	1.7	1,382
医薬品(2.6%)			
ジーエヌアイグループ	—	1.4	4,270
栄研化学	0.5	—	—
JCRファーマ	—	1.5	1,026
ミズホメディアー	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
SWCC	0.3	0.5	2,650
金属製品(2.5%)			
トーカロ	0.8	1.3	2,372
RS Technologies	0.2	0.3	1,203
横河ブリッジホールディングス	0.4	0.7	1,838

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	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・ビー機械	0.1	0.2	909
TOWA	0.3	—	—
澁谷工業	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	—	—
PILLAR	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
JVCケンウッド	2.6	3.5	4,385
IDEC	0.4	0.7	1,754
シライ電子工業	—	0.3	165
MCJ	1.2	1.8	2,665
ワコム	2.2	3.1	2,120
santec Holdings	—	0.2	1,156
日本電波工業	0.4	0.5	540
メイコー	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
SHOEI	—	1.2	2,804
NISSHA	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 (千株)	数	株 (千株)	数 評 価 額 (千円)
メタウォーター	0.3	—	—	—
陸運業(0.5%)				
S B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ユニテッド海運	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	
エニジモ	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	
PR 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지니어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	
ファイバークラウド	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 (千株)	数	株 (千株)	数 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	—	—	
コマ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	
日本紙バルブ商事	0.2	2.2	1,513	
神鋼商事	—	0.1	637	
中央自動車工業	—	0.4	1,902	
伊藤忠エネクス	0.7	—	—	
加賀電子	0.2	0.8	2,276	
K P P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	
コマ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	
Hamee	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 DrugStores	0.1	0.4	1,332	
ギフトホールディングス	—	0.2	657	
アークランズ	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	
GMO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	
スパークス・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)	評 価 額 (千円)
SBI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	—
LAホールディングス	0.1	0.1	461	—
ディア・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	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	—	—	—
UT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	—
アマ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)	評 価 額 (千円)
SBI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・アールジャパンホールディングス	0.2	0.2	173	—
Keeper 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・コーポレーション	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	—
ERIホールディングス	—	0.1	190	—
シグマシス・ホールディングス	0.4	0.6	1,030	—
ウィルグループ	0.3	—	—	—
ブリークアウト・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	—
LITALICO	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	86	139	220,529
	銘柄数<比率>	192	200	<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 末	
		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	5,657,098円
受 取 配 当 金	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	29,194,672
売 買 益	40,189,855
売 買 損	△10,995,183
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	484,046
取 引 益	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。