

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11月24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 | My SMT 日経225 インデックス (ノーロード) | 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。 |
| | 日経225 インデックス マザーファンド(S) | わが国の株式を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | My SMT 日経225 インデックス (ノーロード) | 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。 |
| | 日経225 インデックス マザーファンド(S) | 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1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。 | |

My SMT 日経225インデックス (ノーロード)

運用報告書(全体版)

第7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 |
|------------------|---------------|-----------|-----------|-----------|----------|-----------|----------|------------|
| | 税込 分配金 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | | | | |
| 第3期(2020年10月20日) | 円 11,043 | 円 0 | % 6.4 | 11,102 | % 6.6 | % 97.6 | % 2.3 | 百万円 129 |
| 第4期(2021年10月20日) | 13,882 | 0 | 25.7 | 14,008 | 26.2 | 97.5 | 2.4 | 572 |
| 第5期(2022年10月20日) | 13,063 | 0 | △5.9 | 13,219 | △5.6 | 98.4 | 1.5 | 4,643 |
| 第6期(2023年10月20日) | 15,417 | 0 | 18.0 | 15,627 | 18.2 | 96.1 | 3.9 | 11,515 |
| 第7期(2024年10月21日) | 19,501 | 0 | 26.5 | 19,826 | 26.9 | 97.6 | 2.4 | 26,538 |

(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 | 騰落率 | 騰落率 | | |
| (当期首) 2023年10月20日 | 円 15,417 | % - | 15,627 | % - | % 96.1 | % 3.9 |
| 10月末 | 15,220 | △1.3 | 15,427 | △1.3 | 96.2 | 3.5 |
| 11月末 | 16,515 | 7.1 | 16,743 | 7.1 | 96.6 | 3.6 |
| 12月末 | 16,530 | 7.2 | 16,758 | 7.2 | 97.7 | 2.2 |
| 2024年1月末 | 17,923 | 16.3 | 18,173 | 16.3 | 97.8 | 2.2 |
| 2月末 | 19,357 | 25.6 | 19,625 | 25.6 | 94.3 | 2.1 |
| 3月末 | 20,079 | 30.2 | 20,367 | 30.3 | 96.4 | 3.5 |
| 4月末 | 19,098 | 23.9 | 19,377 | 24.0 | 97.2 | 2.7 |
| 5月末 | 19,141 | 24.2 | 19,419 | 24.3 | 97.9 | 2.0 |
| 6月末 | 19,699 | 27.8 | 19,999 | 28.0 | 98.5 | 1.4 |
| 7月末 | 19,460 | 26.2 | 19,757 | 26.4 | 98.4 | 1.5 |
| 8月末 | 19,241 | 24.8 | 19,541 | 25.1 | 98.7 | 1.3 |
| 9月末 | 18,991 | 23.2 | 19,299 | 23.5 | 98.2 | 2.1 |
| (当期末) 2024年10月21日 | 19,501 | 26.5 | 19,826 | 26.9 | 97.6 | 2.4 |

(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。

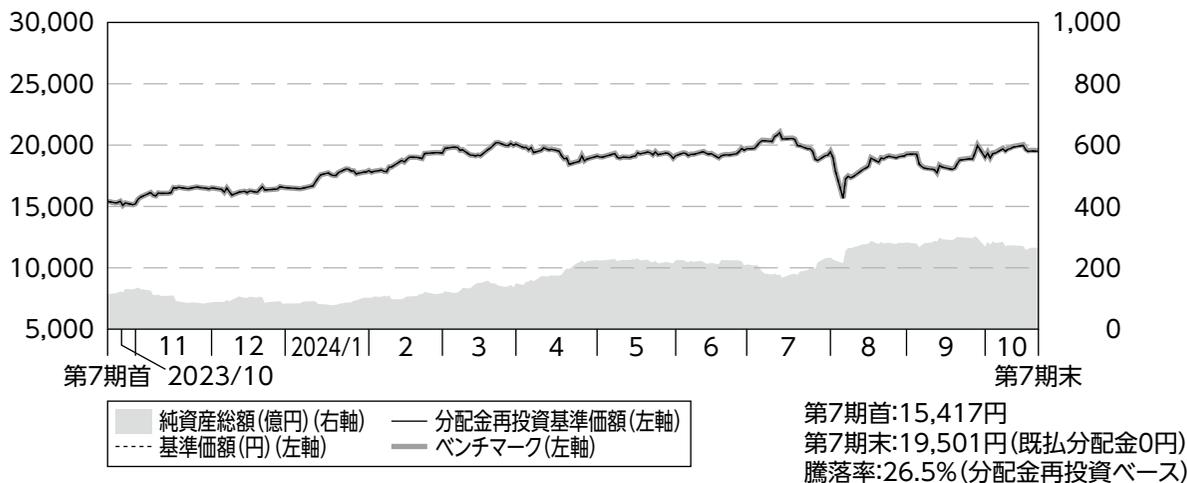
ベンチマークは、日経平均トータルリターン・インデックスです。

日経平均トータルリターン・インデックスとは、株式会社日本経済新聞社が独自に開発した手法により、東京証券取引所プライム市場上場銘柄のうち日経平均株価（日経平均）を構成する225銘柄の値動きだけでなく、各構成銘柄の配当も加味した場合のパフォーマンスを示す指数です。

「日経平均」及び「日経平均トータルリターン・インデックス」（以下、「日経平均」という。）に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は「日経平均」を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延又は中断に関して責任を負いません。また、本件投資信託について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。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、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日経平均トータルリターン・インデックス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

株式への投資は「日経225インデックス マザーファンド(S)」受益証券の組み入れにより行いました。

【「日経225インデックス マザーファンド(S)」の運用経過】

ベンチマークである日経平均トータルリターン・インデックス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。

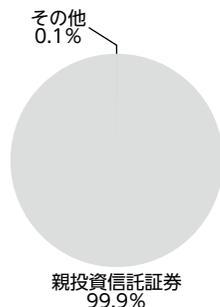
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

| | 当期末 |
|------------------------|-------------|
| | 2024年10月21日 |
| 日経225インデックス マザーファンド(S) | 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。

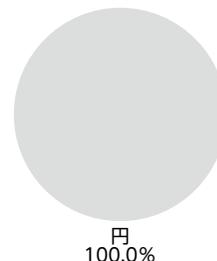
○資産別配分



○国別配分



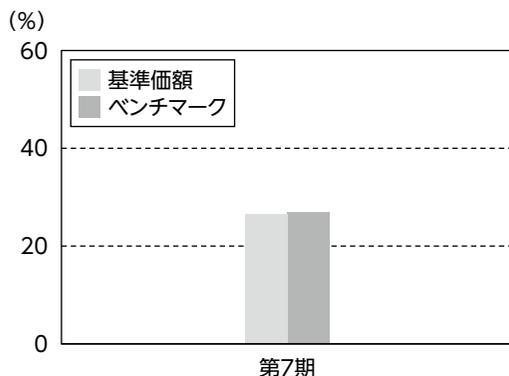
○通貨別配分



(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要因(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7期 | |
|-----------|-------------------------|-------|
| | 2023年10月21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) | 9,501 |

(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

日経225インデックス マザーファンド(S)の受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に投資し、日経平均トータルリターン・インデックス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) 信託報酬 | 28円 | 0.154% | (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18,437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) | (12) | (0.066) | |
| (販売会社) | (12) | (0.066) | |
| (受託会社) | (4) | (0.022) | |
| (b) 売買委託手数料 | 1 | 0.003 | (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) | (1) | (0.003) | |
| (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 | 0.006 | (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、損害賠償請求訴訟に係る費用 |
| (保管費用) | (-) | (-) | |
| (監査費用) | (1) | (0.006) | |
| (その他) | (0) | (0.000) | |
| 合計 | 30 | 0.163 | |

(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。

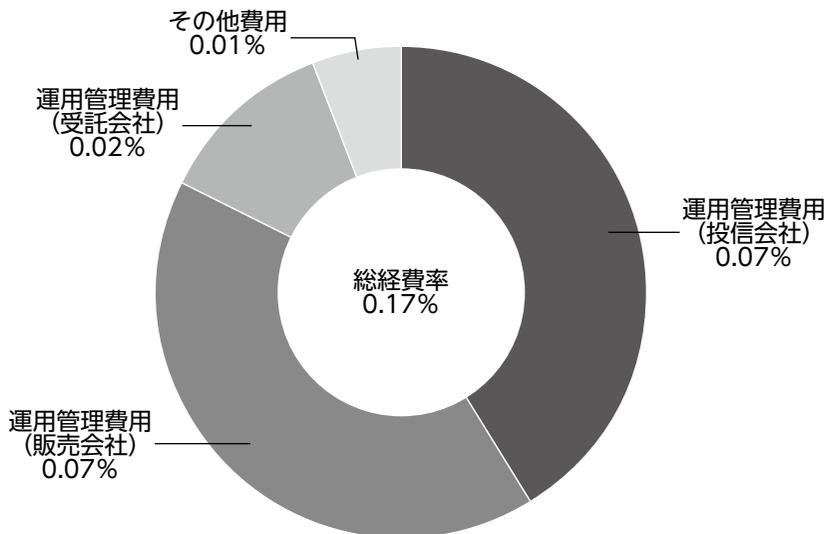
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.17%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 |
| 日経225インデックス マザーファンド(S) | 千口 17,751,083 | 千円 52,929,470 | 千口 13,986,922 | 千円 42,009,423 |

株式売買比率

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

<日経225インデックス マザーファンド(S)>

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------|---------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 153,380,867千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 105,077,430千円 |
| (c) 売買高比率(a)／(b) | 1.45 |

(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 |
| 金 銭 信 託 | 百万円 3 | 百万円 3 | % 100.0 | 百万円 3 | 百万円 3 | % 100.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 111,443 | 12,985 | 11.7 | 111,408 | 12,938 | 11.6 |

(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。

<日経225インデックス マザーファンド(S)>

| 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 |
| 金 銭 信 託 | 百万円 22 | 百万円 22 | % 100.0 | 百万円 22 | 百万円 22 | % 100.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 725,079 | 78,186 | 10.8 | 725,771 | 77,813 | 10.7 |

<平均保有割合 16.7%>

(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。

■利害関係人の発行する有価証券等

<日経225インデックス マザーファンド(S)>

| 種 類 | 当 | | 期 |
|-----|-------|-------|--------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当期末保有額 |
| 株 式 | 47百万円 | 38百万円 | 65百万円 |

(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 |
| 日経225インデックス マザーファンド(S) | 千口 4,596,373 | 千口 8,360,534 | 千円 26,525,466 |

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、37,187,998千口です。

※ 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。

投資信託財産の構成

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 日経225インデックス マザーファンド(S) | 千円 26,525,466 | % 99.1 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 235,983 | 0.9 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 26,761,449 | 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 | 26,761,449,960円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 226,278,668 |
| 日経225インデックス マザーファンド(S) (評価額) | 26,525,466,358 |
| 未 収 入 金 | 9,703,597 |
| 未 収 利 息 | 1,337 |
| (B)負 債 | 222,704,121 |
| 未 払 解 約 金 | 203,380,612 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 18,657,286 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 666,223 |
| (C)純 資 産 総 額(A-B) | 26,538,745,839 |
| 元 本 | 13,608,665,043 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 12,930,080,796 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | 13,608,665,043口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 19,501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 | 212,222円 |
| 受 取 利 息 | 213,943 |
| 支 払 利 息 | △1,721 |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | 1,062,094,384 |
| 売 買 益 | 2,378,596,590 |
| 売 買 損 | △1,316,502,206 |
| (C)信 託 報 酬 等 | △28,419,541 |
| (D)当 期 損 益 金(A+B+C) | 1,033,887,065 |
| (E)前 期 繰 越 損 益 金 | △2,614,445 |
| (F)追 加 信 託 差 損 益 金 | 11,898,808,176 |
| (配 当 等 相 当 額) | (2,606,462,959) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (9,292,345,217) |
| (G)計 (D+E+F) | 12,930,080,796 |
| (H)収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G+H) | 12,930,080,796 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 11,898,808,176 |
| (配 当 等 相 当 額) | (2,718,521,737) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (9,180,286,439) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 1,031,272,620 |

(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7,468,940,613円、期中追加設定元本額は40,726,027,085円、期中一部解約元本額は34,586,302,655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) | | 347,649,118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) | | 681,954,215円 |
| (C) | 収益調整金額 | | 11,898,808,176円 |
| (D) | 分配準備積立金額 | | 1,669,287円 |
| (E) | 分配対象収益額(A+B+C+D) | | 12,930,080,796円 |
| (F) | 期末残存口数 | | 13,608,665,043口 |
| (G) | 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000) | | 9,501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

当ファンドで組入れている親投資信託で運用していた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、親投資信託にて11,572,816円の支払いを受けました。

(和解金支払日:2023年12月22日)

日経225インデックス マザーファンド(S)

運用報告書

第17期（決算日 2024年5月10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2007年9月27日から無期限です。 |
| 運用方針 | わが国の株式を中心に投資を行い、日経平均トータルリターン・インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要運用対象 | わが国の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 組入比率 | 株式先物率 比 | 純資産額 |
|------------------|--------|------|--------|------|---------------|------------|---------|
| | 円 | 騰落率 | 円 | 騰落率 | | | |
| 第13期(2020年5月20日) | 15,466 | △1.2 | 15,506 | △1.1 | 95.5 | 3.0 | 80,224 |
| 第14期(2021年5月20日) | 21,433 | 38.6 | 21,491 | 38.6 | 97.0 | 2.8 | 70,774 |
| 第15期(2022年5月20日) | 20,766 | △3.1 | 20,847 | △3.0 | 97.7 | 2.0 | 80,208 |
| 第16期(2023年5月10日) | 23,108 | 11.3 | 23,233 | 11.4 | 96.7 | 3.2 | 66,629 |
| 第17期(2024年5月10日) | 30,907 | 33.8 | 31,066 | 33.7 | 97.4 | 2.6 | 116,569 |

(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。

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 組入比率 | 株式先物率 比 |
|----------------------|--------|------|--------|------|---------------|------------|
| | 円 | 騰落率 | 円 | 騰落率 | | |
| (当期首) 2023年 5月10日 | 23,108 | — | 23,233 | — | 96.7 | 3.2 |
| 5月末 | 24,523 | 6.1 | 24,642 | 6.1 | 97.6 | 2.4 |
| 6月末 | 26,382 | 14.2 | 26,516 | 14.1 | 97.5 | 2.5 |
| 7月末 | 26,374 | 14.1 | 26,505 | 14.1 | 97.8 | 2.2 |
| 8月末 | 25,950 | 12.3 | 26,080 | 12.3 | 97.9 | 2.1 |
| 9月末 | 25,520 | 10.4 | 25,650 | 10.4 | 94.2 | 6.4 |
| 10月末 | 24,721 | 7.0 | 24,848 | 6.9 | 96.2 | 3.5 |
| 11月末 | 26,828 | 16.1 | 26,967 | 16.1 | 96.6 | 3.6 |
| 12月末 | 26,857 | 16.2 | 26,992 | 16.2 | 97.7 | 2.2 |
| 2024年 1月末 | 29,125 | 26.0 | 29,270 | 26.0 | 97.8 | 2.2 |
| 2月末 | 31,461 | 36.1 | 31,609 | 36.1 | 94.3 | 2.1 |
| 3月末 | 32,639 | 41.2 | 32,804 | 41.2 | 96.5 | 3.5 |
| 4月末 | 31,047 | 34.4 | 31,210 | 34.3 | 97.3 | 2.7 |
| (当期末) 2024年 5月10日 | 30,907 | 33.8 | 31,066 | 33.7 | 97.4 | 2.6 |

(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」で算出しております。

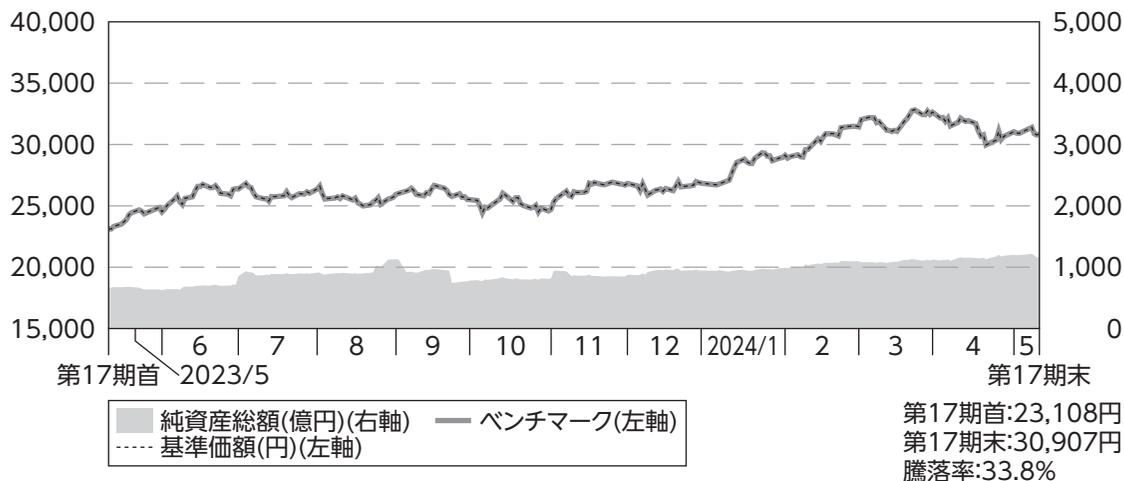
ベンチマークは、日経平均トータルリターン・インデックスです。

日経平均トータルリターン・インデックスとは、株式会社日本経済新聞社が独自に開発した手法により、東京証券取引所プライム市場上場銘柄のうち日経平均株価（日経平均）を構成する225銘柄の値動きだけでなく、各構成銘柄の配当も加味した場合のパフォーマンスを示す指数です。

「日経平均」及び「日経平均トータルリターン・インデックス」（以下、「日経平均」という。）に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は「日経平均」を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延又は中断に関して責任を負いません。また、本件投資信託について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。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)ベンチマークは、2023年5月10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日経平均トータルリターン・インデックス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。

期初は、FRB(米連邦準備理事会)が利上げを見送るといった観測や円安・米ドル高が好感されたことを背景に国内株式市場は上昇しましたが、米長期金利上昇や中東情勢の緊迫化による原油高から下落するなど一進一退の展開となりました。その後は、金融緩和の維持により円安・米ドル高が進み、海外からの資金流入が続いたことなどから大幅な上昇となりました。日銀がマイナス金利を解除したものの、緩和的な金融環境を維持するとの見方から国内株式市場は一段高となり、日経平均株価は過去最高値を更新しましたが、高値警戒感が強まる中、米長期金利の上昇を受けてハイテク株を中心に下落したことや中東情勢に対する警戒感などから、期末にかけては上値の重い展開となりました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークである日経平均トータルリターン・インデックス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

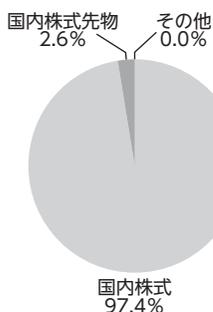
○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 国・地域 | 組入比率 |
|----|-----------------|------|-------|
| 1 | ファーストリテイリング | 日本 | 10.2% |
| 2 | 東京エレクトロン | 日本 | 8.7% |
| 3 | ソフトバンクグループ | 日本 | 3.9% |
| 4 | アドバンテスト | 日本 | 3.4% |
| 5 | 日経平均株価指数先物 2406 | 日本 | 2.6% |
| 6 | 信越化学工業 | 日本 | 2.4% |

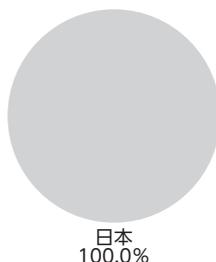
| 順位 | 銘柄名 | 国・地域 | 組入比率 |
|-------|--------|------|------|
| 7 | KDDI | 日本 | 2.2% |
| 8 | ダイキン工業 | 日本 | 2.1% |
| 9 | ファナック | 日本 | 1.9% |
| 10 | テルモ | 日本 | 1.8% |
| 組入銘柄数 | | 226 | |

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

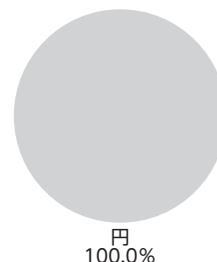
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

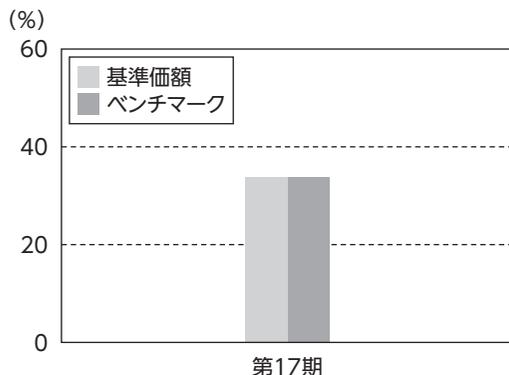


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未取・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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2.6%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

主としてわが国の株式を中心に投資を行い、日経平均トータルリターン・インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 (2023年5月11日~2024年5月10日) | | 項目の概要 |
|--|---|---|---|
| | 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) | 1円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (1) | 0.003% (0.001) (-) (-) (-) (-) (-) (0.003) | (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) | 0 (-) (-) (0) | 0.001 (-) (-) (0.001) | (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、損害賠償請求訴訟に係る費用 |
| 合計 | 1 | 0.004 | |

(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(27,618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 26,973 (4,783) | 千円 118,844,827 (-) | 千株 21,429 | 千円 93,346,190 |

(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 103,742 | 百万円 103,706 | 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 | 212,191,018千円 |
| (b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 91,626,723千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b) | 2.31 |

(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 |
| 金 銭 信 託 | 百万円 64 | 百万円 64 | % 100.0 | 百万円 64 | 百万円 64 | % 100.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 866,699 | 61,888 | 7.1 | 863,175 | 61,147 | 7.1 |

(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 | | 期 |
|-----|-------|-------|--------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当期末保有額 |
| 株 式 | 64百万円 | 53百万円 | 63百万円 |

(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・ホールディングス株式会社です。

※ 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) | 株数 (千株) | 評価額 (千円) |
| 水産・農林業(0.1%) | | | |
| ニッスイ | 75 | 97.1 | 93,662 |
| 鉱業(0.1%) | | | |
| I N P E X | 30 | 38.9 | 94,293 |
| 建設業(1.6%) | | | |
| コムシスホールディングス | 75 | 97.1 | 348,394 |
| 大成建設 | 15 | 19.4 | 116,380 |
| 大林組 | 75 | 97.1 | 170,896 |
| 清水建設 | 75 | 97.1 | 101,178 |
| 長谷工コーポレーション | 15 | 19.4 | 37,345 |
| 鹿島建設 | 37.5 | 48.6 | 146,772 |
| 大和ハウス工業 | 75 | 97.1 | 415,102 |
| 積水ハウス | 75 | 97.1 | 353,249 |
| 日揮ホールディングス | 75 | 97.1 | 133,755 |
| 食料品(3.1%) | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 75 | 97.1 | 203,036 |
| 明治ホールディングス | 30 | 38.9 | 134,516 |
| 日本ハム | 37.5 | 48.6 | 242,465 |
| サッポロホールディングス | 15 | 19.4 | 109,629 |
| アサヒグループホールディングス | 75 | 97.1 | 532,399 |
| キリンホールディングス | 75 | 97.1 | 223,038 |
| 宝ホールディングス | 75 | — | — |
| キッコーマン | 75 | 485.7 | 890,773 |
| 味の素 | 75 | 97.1 | 591,241 |
| ニチレイ | 37.5 | 48.6 | 190,463 |
| 日本たばこ産業 | 75 | 97.1 | 428,211 |
| 繊維製品(0.1%) | | | |
| 帝人 | 15 | 19.4 | 30,613 |
| 東レ | 75 | 97.1 | 69,853 |
| パルプ・紙(0.1%) | | | |
| 王子ホールディングス | 75 | 97.1 | 59,765 |
| 日本製紙 | 7.5 | 9.7 | 10,757 |
| 化学(6.5%) | | | |
| クラレ | 75 | 97.1 | 168,031 |
| 旭化成 | 75 | 97.1 | 104,285 |
| レゾナック・ホールディングス | 7.5 | 9.7 | 35,104 |
| 住友化学 | 75 | 97.1 | 32,858 |
| 日産化学 | 75 | 97.1 | 535,215 |
| 東ソー | 37.5 | 48.6 | 107,916 |
| トクヤマ | 15 | 19.4 | 60,722 |
| デンカ | 15 | 19.4 | 44,649 |
| 信越化学工業 | 375 | 485.7 | 2,817,545 |
| 三井化学 | 15 | 19.4 | 87,455 |
| 三菱ケミカルグループ | 37.5 | 48.6 | 44,094 |

| 銘柄 | 当期首(前期末) | | |
|-----------------------|------------|------------|-------------|
| | 株数 (千株) | 株数 (千株) | 評価額 (千円) |
| U B E | 7.5 | 9.7 | 28,765 |
| 花王 | 75 | 97.1 | 673,776 |
| D I C | 7.5 | 9.7 | 28,935 |
| 富士フイルムホールディングス | 75 | 291.4 | 976,772 |
| 資生堂 | 75 | 97.1 | 437,921 |
| 日東電工 | 75 | 97.1 | 1,210,837 |
| 医薬品(5.7%) | | | |
| 協和キリン | 75 | 97.1 | 259,208 |
| 武田薬品工業 | 75 | 97.1 | 400,925 |
| アステラス製薬 | 375 | 485.7 | 741,906 |
| 住友ファーマ | 75 | 97.1 | 39,519 |
| 塩野義製薬 | 75 | 97.1 | 727,181 |
| 中外製薬 | 225 | 291.4 | 1,441,264 |
| エーザイ | 75 | 97.1 | 659,600 |
| 第一三共 | 225 | 291.4 | 1,569,189 |
| 大塚ホールディングス | 75 | 97.1 | 639,500 |
| 石油・石炭製品(0.2%) | | | |
| 出光興産 | 30 | 194.3 | 207,220 |
| E N E O Sホールディングス | 75 | 97.1 | 69,873 |
| ゴム製品(0.8%) | | | |
| 横浜ゴム | 37.5 | 48.6 | 198,628 |
| ブリヂストン | 75 | 97.1 | 668,436 |
| ガラス・土石製品(0.6%) | | | |
| A G C | 15 | 19.4 | 106,971 |
| 日本板硝子 | 7.5 | — | — |
| 日本電気硝子 | 22.5 | 29.1 | 104,265 |
| 住友大阪セメント | 7.5 | — | — |
| 太平洋セメント | 7.5 | 9.7 | 36,287 |
| 東海カーボン | 75 | 97.1 | 94,284 |
| T O T O | 37.5 | 48.6 | 197,364 |
| 日本碍子 | 75 | 97.1 | 203,375 |
| 鉄鋼(0.1%) | | | |
| 日本製鉄 | 7.5 | 9.7 | 32,107 |
| 神戸製鋼所 | 7.5 | 9.7 | 19,230 |
| J F Eホールディングス | 7.5 | 9.7 | 22,445 |
| 大洋洋金属 | 7.5 | — | — |
| 非鉄金属(0.9%) | | | |
| 三井金属鉱業 | 7.5 | 9.7 | 49,208 |
| 三菱マテリアル | 7.5 | 9.7 | 29,526 |
| 住友金属鉱山 | 37.5 | 48.6 | 240,278 |
| D O W Aホールディングス | 15 | 19.4 | 114,751 |
| 古河電気工業 | 7.5 | 9.7 | 34,260 |
| 住友電気工業 | 75 | 97.1 | 234,787 |
| フジクラ | 75 | 97.1 | 274,987 |

| 銘柄 | 当期首(前期末) | | |
|--------------------|------------|------------|-------------|
| | 株数 (千株) | 株数 (千株) | 評価額 (千円) |
| 金属製品(0.0%) | | | |
| SUMCO | 7.5 | 9.7 | 25,132 |
| 機械(5.7%) | | | |
| 日本製鋼所 | 15 | 19.4 | 75,524 |
| オークマ | 15 | 19.4 | 140,378 |
| アマダ | 75 | 97.1 | 170,944 |
| ディスコ | — | 19.4 | 987,072 |
| SMC | 7.5 | 9.7 | 818,001 |
| 小松製作所 | 75 | 97.1 | 449,767 |
| 住友重機械工業 | 15 | 19.4 | 85,980 |
| 日立建機 | 75 | 97.1 | 438,309 |
| クボタ | 75 | 97.1 | 240,710 |
| 住原製作所 | 15 | 19.4 | 260,057 |
| ダイキン工業 | 75 | 97.1 | 2,396,913 |
| 日本精工 | 75 | 97.1 | 80,398 |
| NTN | 75 | 97.1 | 29,906 |
| ジェイテクト | 75 | 97.1 | 117,636 |
| 三井E&S | 7.5 | — | — |
| 日立造船 | 15 | 19.4 | 23,862 |
| 三菱重工業 | 7.5 | 97.1 | 124,385 |
| IHI | 7.5 | 9.7 | 38,470 |
| 電気機器(27.2%) | | | |
| コニカミノルタ | 75 | 97.1 | 52,608 |
| ミネベアミツミ | 75 | 97.1 | 292,465 |
| 日立製作所 | 15 | 19.4 | 280,330 |
| 三菱電機 | 75 | 97.1 | 270,229 |
| 富士電機 | 15 | 19.4 | 188,839 |
| 安川電機 | 75 | 97.1 | 624,255 |
| ソシオネクスト | — | 97.1 | 431,124 |
| ニデック | 60 | 77.7 | 555,710 |
| オムロン | 75 | 97.1 | 575,803 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 15 | 19.4 | 57,938 |
| 日本電気 | 7.5 | 9.7 | 104,032 |
| 富士通 | 7.5 | 97.1 | 227,893 |
| ルネサスエレクトロニクス | 75 | 97.1 | 245,663 |
| セイコーエプソン | 150 | 194.3 | 488,567 |
| パナソニック ホールディングス | 75 | 97.1 | 128,366 |
| シャープ | 75 | 97.1 | 83,739 |
| ソニーグループ | 75 | 97.1 | 1,137,041 |
| TDK | 225 | 291.4 | 2,010,660 |
| アルプスアルパイン | 75 | 97.1 | 146,232 |
| 横河電機 | 75 | 97.1 | 392,284 |
| アドバンテスト | 150 | 777.1 | 3,976,420 |
| キーエンス | 7.5 | 9.7 | 680,552 |
| レーザーテック | — | 38.9 | 1,592,566 |
| カシオ計算機 | 75 | 97.1 | 126,861 |
| ファナック | 375 | 485.7 | 2,269,190 |
| 京セラ | 150 | 777.1 | 1,461,336 |

| 銘柄 | 当期首(前期末) | | |
|---------------------|------------|------------|-------------|
| | 株数 (千株) | 株数 (千株) | 評価額 (千円) |
| 太陽誘電 | 75 | 97.1 | 315,575 |
| 村田製作所 | 60 | 233.1 | 635,197 |
| SCREENホールディングス | 15 | 38.9 | 600,810 |
| キヤノン | 112.5 | 145.7 | 638,748 |
| リコー | 75 | 97.1 | 125,987 |
| 東京エレクトロン | 225 | 291.4 | 10,199,000 |
| 輸送用機器(4.8%) | | | |
| デンソー | 75 | 388.6 | 1,010,360 |
| 川崎重工業 | 7.5 | 9.7 | 56,463 |
| 日産自動車 | 75 | 97.1 | 53,589 |
| いすゞ自動車 | 37.5 | 48.6 | 94,089 |
| トヨタ自動車 | 375 | 485.7 | 1,663,522 |
| 日野自動車 | 75 | 97.1 | 44,908 |
| 三菱自動車工業 | 7.5 | 9.7 | 4,340 |
| マツダ | 15 | 19.4 | 32,689 |
| 本田技研工業 | 150 | 582.8 | 1,012,032 |
| スズキ | 75 | 388.6 | 694,428 |
| SUBARU | 75 | 97.1 | 322,857 |
| ヤマハ発動機 | 75 | 291.4 | 419,033 |
| 精密機器(3.6%) | | | |
| テルモ | 300 | 777.1 | 2,041,441 |
| ニコン | 75 | 97.1 | 164,438 |
| オリンパス | 300 | 388.6 | 889,505 |
| HOYA | 37.5 | 48.6 | 879,660 |
| シチズン時計 | 75 | 97.1 | 99,139 |
| その他製品(2.1%) | | | |
| バンダイナムコホールディングス | 225 | 291.4 | 915,287 |
| TOPPANホールディングス | 37.5 | 48.6 | 183,173 |
| 大日本印刷 | 37.5 | 48.6 | 225,649 |
| ヤマハ | 75 | 97.1 | 347,812 |
| 任天堂 | 75 | 97.1 | 762,137 |
| 電気・ガス業(0.2%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 7.5 | 9.7 | 9,273 |
| 中部電力 | 7.5 | 9.7 | 19,303 |
| 関西電力 | 7.5 | 9.7 | 23,590 |
| 東京瓦斯 | 15 | 19.4 | 68,113 |
| 大阪瓦斯 | 15 | 19.4 | 69,335 |
| 陸運業(1.0%) | | | |
| 東武鉄道 | 15 | 19.4 | 56,531 |
| 東急 | 37.5 | 48.6 | 90,784 |
| 小田急電鉄 | 37.5 | 48.6 | 85,900 |
| 京王電鉄 | 15 | 19.4 | 73,991 |
| 京成電鉄 | 37.5 | 48.6 | 286,205 |
| 東日本旅客鉄道 | 7.5 | 29.1 | 83,837 |
| 西日本旅客鉄道 | 7.5 | 19.4 | 60,547 |
| 東海旅客鉄道 | 7.5 | 48.6 | 167,232 |
| ヤマトホールディングス | 75 | 97.1 | 170,701 |
| NIPPON EXPRESS | 7.5 | 9.7 | 77,357 |

| 銘柄 | 当期首(前期末) | | |
|-----------------------|------------|------------|-------------|
| | 株数 (千株) | 株数 (千株) | 評価額 (千円) |
| 海運業(0.4%) | | | |
| 日本郵船 | 22.5 | 29.1 | 135,256 |
| 商船三井 | 22.5 | 29.1 | 144,597 |
| 川崎汽船 | 22.5 | 87.4 | 200,320 |
| 空運業(0.3%) | | | |
| 日本航空 | 75 | 97.1 | 261,538 |
| ANAホールディングス | 7.5 | 9.7 | 29,119 |
| 倉庫・運輸関連業(0.2%) | | | |
| 三菱倉庫 | 37.5 | 48.6 | 252,574 |
| 情報・通信業(9.7%) | | | |
| ネクソン | 150 | 194.3 | 499,156 |
| メルカリ | — | 97.1 | 186,237 |
| LINEヤフー | 30 | 38.9 | 14,587 |
| トレンドマイクロ | 75 | 97.1 | 725,142 |
| 日本電信電話 | 30 | 971.4 | 157,658 |
| KDDI | 450 | 582.8 | 2,511,868 |
| ソフトバンク | 75 | 97.1 | 189,684 |
| 東宝 | 7.5 | 9.7 | 49,217 |
| NTTデータグループ | 375 | 485.7 | 1,117,595 |
| コナミグループ | 75 | 97.1 | 999,159 |
| ソフトバンクグループ | 450 | 582.8 | 4,590,715 |
| 卸売業(3.7%) | | | |
| 双日 | 7.5 | 9.7 | 40,943 |
| 伊藤忠商事 | 75 | 97.1 | 704,946 |
| 丸紅 | 75 | 97.1 | 296,737 |
| 豊田通商 | 75 | 97.1 | 950,317 |
| 三井物産 | 75 | 97.1 | 765,050 |
| 住友商事 | 75 | 97.1 | 411,995 |
| 三菱商事 | 75 | 291.4 | 986,389 |
| 小売業(13.0%) | | | |
| J.フロントリテイリング | 37.5 | 48.6 | 70,494 |
| ZOZO | — | 97.1 | 326,450 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 75 | 97.1 | 224,883 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 75 | 291.4 | 590,522 |
| 高島屋 | 37.5 | 48.6 | 112,338 |
| 丸井グループ | 75 | 97.1 | 232,408 |
| イオン | 75 | 97.1 | 323,925 |
| ニトリホールディングス | — | 48.6 | 1,005,291 |
| ファーストリテイリング | 225 | 291.4 | 11,865,808 |
| 銀行業(0.7%) | | | |
| しずおかフィナンシャルグループ | 75 | 97.1 | 143,416 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 75 | 97.1 | 82,758 |
| あおぞら銀行 | 7.5 | 9.7 | 23,430 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 75 | 97.1 | 154,680 |
| りそなホールディングス | 7.5 | 9.7 | 9,371 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 7.5 | 19.4 | 63,612 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 7.5 | 9.7 | 87,300 |
| 千葉銀行 | 75 | 97.1 | 125,987 |

| 銘柄 | 当期首(前期末) | | |
|---------------------------|----------------------|------------|-------------------|
| | 株数 (千株) | 株数 (千株) | 評価額 (千円) |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 15 | 19.4 | 81,266 |
| みずほフィナンシャルグループ | 7.5 | 9.7 | 29,749 |
| 証券・商品先物取引業(0.2%) | | | |
| 大和証券グループ本社 | 75 | 97.1 | 112,781 |
| 野村ホールディングス | 75 | 97.1 | 86,156 |
| 松井証券 | 75 | — | — |
| 保険業(1.1%) | | | |
| SOMPOホールディングス | 15 | 58.3 | 184,577 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 22.5 | 87.4 | 253,678 |
| 第一生命ホールディングス | 7.5 | 9.7 | 35,075 |
| 東京海上ホールディングス | 112.5 | 145.7 | 745,255 |
| T&Dホールディングス | 15 | 19.4 | 52,166 |
| その他金融業(0.8%) | | | |
| クレディセゾン | 75 | 97.1 | 286,396 |
| オリックス | 75 | 97.1 | 327,032 |
| 日本取引所グループ | 75 | 97.1 | 348,589 |
| 不動産業(1.3%) | | | |
| 東急不動産ホールディングス | 75 | 97.1 | 113,509 |
| 三井不動産 | 75 | 291.4 | 459,683 |
| 三菱地所 | 75 | 97.1 | 284,794 |
| 東京建物 | 37.5 | 48.6 | 124,100 |
| 住友不動産 | 75 | 97.1 | 534,244 |
| サービス業(4.1%) | | | |
| エムスリー | 180 | 233.1 | 378,437 |
| ディー・エヌ・エー | 22.5 | 29.1 | 45,701 |
| 電通グループ | 75 | 97.1 | 412,772 |
| オリエンタルランド | 75 | 97.1 | 431,609 |
| サイバーエージェント | 60 | 77.7 | 77,894 |
| 楽天グループ | 75 | 97.1 | 78,427 |
| リクルートホールディングス | 225 | 291.4 | 2,021,150 |
| 日本郵政 | 75 | 97.1 | 147,446 |
| セコム | 75 | 97.1 | 1,041,883 |
| 合計 | 株数・金額 | 株数 | 評価額 |
| | 15,622 | 25,951 | 113,575,889 |
| | 銘柄数<比率> | 銘柄数 | <比率> |
| | 225 | 225 | <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 日経225 | 2,982 | — |

投資信託財産の構成

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 千円 113,575,889 | % 94.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 6,379,476 | 5.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 119,955,365 | 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5月10日現在 |
|-------------------|-----------------------|
| (A)資 産 | 119,954,699,108円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 5,418,864,692 |
| 株 式(評価額) | 113,575,889,060 |
| 未 収 入 金 | 46,107,100 |
| 未 収 配 当 金 | 793,614,160 |
| 未 収 利 息 | 10,006 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 120,214,090 |
| (B)負 債 | 3,385,262,220 |
| 未 払 解 約 金 | 3,385,262,220 |
| (C)純 資 産 総 額(A-B) | 116,569,436,888 |
| 元 本 | 37,716,360,984 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 78,853,075,904 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | 37,716,360,984口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 30,907円 |

■損益の状況

| 項 目 | 当 期 自 2023年5月11日 至 2024年5月10日 |
|-----------------------|-------------------------------------|
| (A)配 当 等 収 益 | 1,692,512,670円 |
| 受 取 配 当 金 | 1,681,715,710 |
| 受 取 利 息 | 313,816 |
| そ の 他 収 益 金 | 11,756,410 |
| 支 払 利 息 | △1,273,266 |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | 23,625,515,010 |
| 売 買 益 | 26,698,033,711 |
| 売 買 損 | △3,072,518,701 |
| (C)先 物 取 引 等 取 引 損 益 | 789,949,270 |
| 取 引 益 | 1,699,976,320 |
| 取 引 損 | △910,027,050 |
| (D)そ の 他 費 用 | △703,323 |
| (E)当 期 損 益 金(A+B+C+D) | 26,107,273,627 |
| (F)前 期 繰 越 損 益 金 | 37,796,188,894 |
| (G)追 加 信 託 差 損 益 金 | 91,303,835,905 |
| (H)解 約 差 損 益 金 | △76,354,222,522 |
| (I)計 (E+F+G+H) | 78,853,075,904 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I) | 78,853,075,904 |

(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28,833,672,919円、期中追加設定元本額は54,642,285,317円、期中一部解約元本額は45,759,597,252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 日経225 インデックス・オープン | 12,767,002,842円 |
| 日経225オープン(適格機関投資家専用) | 11,156,897,152円 |
| My SMT 日経225インデックス(ノーロード) | 7,288,970,817円 |
| 日経225オープン2(適格機関投資家専用) | 3,668,614,094円 |
| 日経225インデックスファンド | 1,217,162,670円 |
| 日経225オープン3(適格機関投資家専用) | 911,605,283円 |
| 日経225インデックスe | 650,830,775円 |
| 私募日経225パッシブファンド(適格機関投資家専用) | 55,277,351円 |

お知らせ

ベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年6月28日)

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、11,572,816円の支払いを受けました。

(和解金支払日:2023年12月22日)