

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／内外／株式／インデックス型	
信託期間	信託期間は2018年10月19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 MIRAIIndex ロボ	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。
	ロボインデックスマザーファンド	日本を含む世界各国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。以下同じ。)を主要投資対象とします。
組入制限	SMT MIRAIIndex ロボ	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	ロボ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割合には制限を設けません。
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。	

SMT MIRAIIndex ロボ

運用報告書(全体版)

第6期(決算日 2024年3月15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	株式先物率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配率)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
第2期(2020年3月16日)	円	円	%			%	%	%	百万円
	10,908	0	△2.9	11,039	△2.5	96.5	2.8	—	368
第3期(2021年3月15日)	20,341	0	86.5	20,948	89.8	96.9	2.6	—	758
第4期(2022年3月15日)	19,689	0	△3.2	20,198	△3.6	92.0	7.6	—	894
第5期(2023年3月15日)	21,386	0	8.6	22,077	9.3	97.1	2.4	—	970
第6期(2024年3月15日)	31,892	0	49.1	33,194	50.4	94.7	5.1	—	1,349

(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」、「投資信託証券組入比率」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、FactSet Global Robotics & Automation Index (税引後配当込み、円換算ベース) です。

FactSet Global Robotics & Automation Indexとは、当社がFactSet UK Limitedと共同開発したスマートベータ指数^(※1)で、世界のロボット関連企業^(※2)の中から総資産に占める売上総利益の割合(売上総利益÷総資産)の原則上位50銘柄で構成される指数です。

- ・構成銘柄の入替えは年1回、ウェイトのリバランスは年2回行います。
 - ・構成銘柄のウェイトは浮動株調整後の時価総額基準とし、リバランス時の1銘柄のウェイトは最大5%とします。
- ※1 スマートベータ指数とは、個別銘柄の株価の単純平均結果又は時価総額による加重平均結果に基づく従来から存在する指数とは異なり、個別銘柄の株価や財務指標に関する分析結果等、指数の構成銘柄や構成比率の決定時に個別銘柄に関する特定の要素を勘案したうえで算出される指数をいいます。このため、スマートベータ指数は必ずしも市場全体の平均や値動きを示す指数ではありません。
- ※2 ロボット関連企業とは、売上の50%超がロボット関連事業(オートメーション関連事業を含みます。)から得ている企業を言います。
- 「税引後配当込み」指数は、税引後の配当収益を考慮して算出した指数です。
- 「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

FactSet UK Limited及びその関連会社(以下「FactSet」)は、当ファンドの支援、保証、販売もしくは販売促進をしているわけではありません。FactSetは、明示又は黙示を問わず、当ファンドの保有者もしくはいかなる一般人に対して、株式全般又は特に当ファンドへの投資の妥当性、もしくは全般的な株式市場のパフォーマンスを追従する当インデックスの能力に関して、一切の表明もしくは保証をしているものではありません。FactSetは当インデックスの決定、構成、又は計算において、当社もしくは当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。FactSetと当社との間にある唯一の関係は、当社又は当ファンドに関係なくFactSetによって決定・構成・計算される当インデックスもしくはFactSetの特定の商標及び商標名のライセンス供与です。FactSetは、当ファンドの価格もしくは金額の決定、新規設定又は販売のタイミングの決定、又は換金される計算式の決定に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。FactSetは、インデックスの運営、マーケティング又は取引に関連する義務又は責任を負いません。

FactSetは、FactSet Global Robotics & Automation Indexの正確性及び、又は完全性を保証するものではありません。また、その中に含まれるデータ及びインデックス使用許諾者は、いかなる誤り、欠落又は中断について責任を負うものではありません。FactSetは、インデックスの使用許諾者、当ファンドの所有者、又は当インデックス又はそれに含まれるすべてのデータの使用に起因する他の人物又は組織によって得られる結果について、明示的又は黙示的に保証されるものではありません。FactSetは、明示的又は黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックス又はそれに含まれるすべてのデータの商品性、特定の目的又は使用への適合性について、一切の保証を明示的に否認します。これに限定されず、FactSetは、たとえそのような損害の可能性について知らされていたとしても、特別損害、懲罰的損害、間接的損害又は派生的損害(逸失利益を含む)に対する責任を一切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 率 比	投 資 信 託 組 入 比 率	信 託 券 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(当 期 首) 2023年 3月15日	円 21,386	% —	22,077	% —	% 97.1	% 2.4	% —	% —
3月末	22,276	4.2	22,971	4.1	97.1	2.4	—	—
4月末	21,542	0.7	22,149	0.3	97.0	2.5	—	—
5月末	25,402	18.8	26,277	19.0	98.7	1.1	—	—
6月末	27,172	27.1	28,114	27.3	98.2	1.5	—	—
7月末	27,330	27.8	28,287	28.1	98.0	1.1	—	—
8月末	27,718	29.6	28,664	29.8	97.4	1.9	—	—
9月末	27,093	26.7	28,062	27.1	96.7	2.6	—	—
10月末	25,479	19.1	26,389	19.5	97.2	2.3	—	—
11月末	28,406	32.8	29,432	33.3	98.4	0.4	—	—
12月末	29,475	37.8	30,633	38.8	96.9	2.7	—	—
2024年 1月末	31,428	47.0	32,697	48.1	94.9	4.6	—	—
2月末	32,034	49.8	33,322	50.9	94.3	5.4	—	—
(当 期 末) 2024年 3月15日	31,892	49.1	33,194	50.4	94.7	5.1	—	—

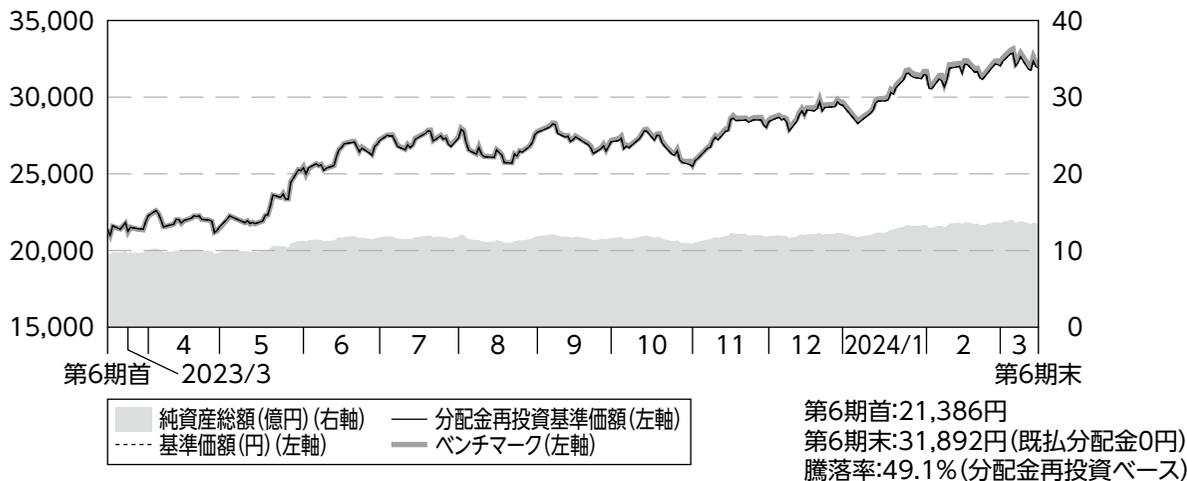
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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」、「投資信託証券組入比率」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3月15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FactSet Global Robotics & Automation Index (税引後配当込み、円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。堅調な経済指標や好調な企業業績を背景にしたソフトランディング期待やAI関連市場への成長期待から株式市場が上昇する中、個別銘柄としては、エヌビディア(米国、半導体・半導体製造装置)、ハブスポット(米国、ソフトウェア・サービス)などが大きく上昇し基準価額に対してプラスに寄与しました。

投資環境



グローバル株式市場は上昇しました。期初は金融システム不安が広がりましたが、米当局の迅速な対応により過度な懸念が後退し上昇に転じました。4月～7月は好調な企業業績や堅調な米国経済指標を背景にソフトランディング期待が広がり続伸しました。8月以降は米国の金融引き締め継続が懸念された他、地政学リスクの高まりから投資家心理が悪化し下落に転じました。11月以降はインフレ指標の鈍化を受け、翌年の早期利下げ期待が高まり上昇しました。2024年以降はインフレ指標の高止まりによる利下げ開始時期の先送りが予想されるもののAI関連市場への成長期待やソフトランディング期待により堅調に推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

「ロボインデックスマザーファンド」受益証券を高位に組み入れ運用しました。

【「ロボ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FactSet Global Robotics & Automation Index（税引後配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む世界の株式を高位に組み入れ運用を行いました。なお、先物はヘッジ目的で利用しました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、個別銘柄の構成比をベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

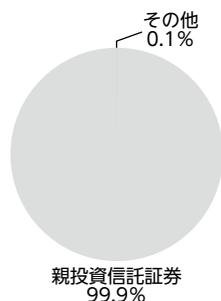
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

	当期末
	2024年3月15日
ロボ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。

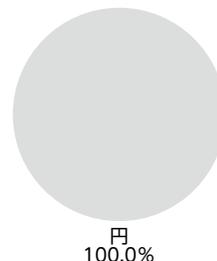
○資産別配分



○国別配分



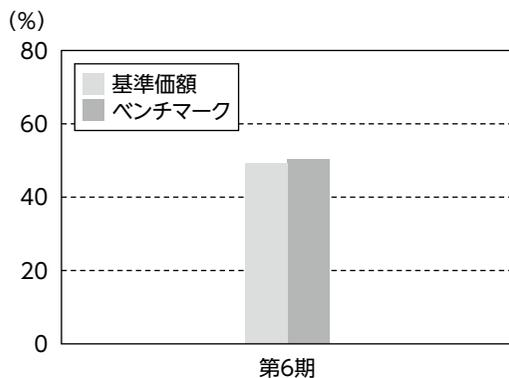
○通貨別配分



(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、プラスの影響としては先物要因※、マイナスの影響としては信託報酬要因、キャッシュ要因などです。

※取引コスト低減のために利用している先物とベンチマークとのリターン差による乖離要因。

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6期	
	2023年3月16日~2024年3月15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)	21,892

(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

ロボ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、主として日本を含む世界各国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)に投資し、FactSet Global Robotics & Automation Index(税引後配当込み、円換算ベース)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3月16日~2024年3月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	209円	0.770%	(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27,112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)	(104)	(0.385)	
(販売会社)	(95)	(0.352)	
(受託会社)	(9)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	4	0.013	
(株式)	(3)	(0.011)	
(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)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	5	0.019	(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)	(5)	(0.019)	
(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	28	0.105	(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)	(27)	(0.099)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	246	0.907	

(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。

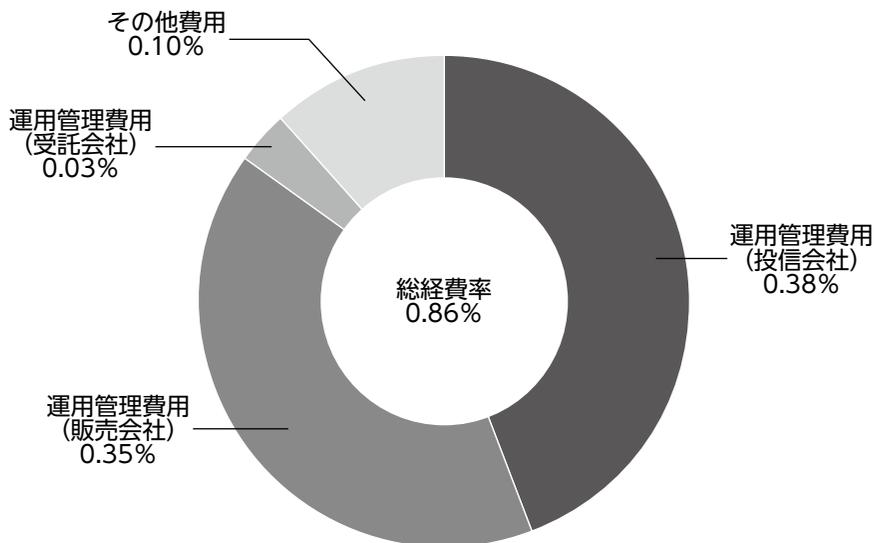
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.86%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
ロボインデックスマザーファンド	43,708	126,853	76,848	214,444

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

<ロボ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	877,754千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	1,154,174千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.76

(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	0.015726	0.015726	100.0	0.015655	0.015655	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,069	81	7.6	1,068	81	7.6

(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。

<ロボ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	%
為 替 直 物 取 引	191	177	92.7	247	233	94.3
金 銭 信 託	0.012009	0.012009	100.0	0.011951	0.011951	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	759	52	6.9	754	52	6.9

<平均保有割合 98.2%>

(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。

自社による当ファンドの設定・解約状況

当期首残高 (元)	当期設定 元	当期解約 元	当期末残高 (元)	取引の理由
千円 200,000	千円 -	千円 -	千円 200,000	当初設定時における取得

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
ロボインデックスマザーファンド	千口 438,517	千口 405,377	千円 1,348,609

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、417,004千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ロボインデックスマザーファンド	千円 1,348,609	% 99.5
コール・ローン等、その他	6,910	0.5
投資信託財産総額	1,355,519	100.0

(注1) ロボインデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,310,735千円)の投資信託財産総額(1,387,691千円)に対する比率は94.5%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=148.59円
1スイスフラン=167.96円
1新台幣ドル=4.7122円

1ユーロ=161.68円
1ノルウェークローネ=14.03円
1イスラエルシェケル=40.645円

1イギリスポンド=189.30円
1オーストラリアドル=97.62円

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3月15日現在
(A)資 産	1,355,519,656円
コール・ローン等	6,492,160
ロボインデックス マザーファンド(評価額)	1,348,609,341
未 収 入 金	418,155
(B)負 債	6,233,303
未 払 解 約 金	1,484,547
未 払 信 託 報 酬	4,715,132
未 払 利 息	1
そ の 他 未 払 費 用	33,623
(C)純 資 産 総 額(A-B)	1,349,286,353
元 本	423,076,325
次 期 繰 越 損 益 金	926,210,028
(D)受 益 権 総 口 数	423,076,325口
1万口当たり基準価額(C/D)	31,892円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年3月16日 至 2024年3月15日
(A)配 当 等 収 益	△1,420円
受 取 利 息	9
支 払 利 息	△1,429
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	389,236,864
売 買 益	462,173,660
売 買 損	△72,936,796
(C)信 託 報 酬 等	△9,014,098
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	380,221,346
(E)前 期 繰 越 損 益 金	89,648,737
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	456,339,945
(配 当 等 相 当 額)	(224,961,953)
(売 買 損 益 相 当 額)	(231,377,992)
(G)計 (D+E+F)	926,210,028
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	926,210,028
追 加 信 託 差 損 益 金	456,339,945
(配 当 等 相 当 額)	(225,075,173)
(売 買 損 益 相 当 額)	(231,264,772)
分 配 準 備 積 立 金	469,870,083

- (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454,031,102円、期中追加設定元本額は119,128,580円、期中一部解約元本額は150,083,357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)	5,374,464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)	359,451,166円
(C) 収益調整金額	456,339,945円
(D) 分配準備積立金額	105,044,453円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	926,210,028円
(F) 期末残存口数	423,076,325口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	21,892円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年12月16日)

ロボインデックスマザーファンド

運用報告書

第6期（決算日 2024年3月15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2018年10月19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	日本を含む世界各国の金融商品取引所等に上場している株式（預託証券（DR）を含みます。以下同じ。）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割合には制限を設けません。

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1万円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 期中騰落率	ベンチマーク		株式組 比率	株式先 比率	株式物 率	投資信託 証券組 入比率	純資産 総額
		期中騰落率	期中騰落率					
第2期(2020年3月16日)	円 11,026	% △2.1	% 11,039	% △2.5	% 96.5	% 2.8	% —	百万円 367
第3期(2021年3月15日)	20,727	88.0	20,948	89.8	96.9	2.6	—	757
第4期(2022年3月15日)	20,218	△2.5	20,198	△3.6	92.1	7.6	—	894
第5期(2023年3月15日)	22,132	9.5	22,077	9.3	97.2	2.4	—	978
第6期(2024年3月15日)	33,268	50.3	33,194	50.4	94.8	5.1	—	1,387

(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、FactSet Global Robotics & Automation Index (税引後配当込み、円換算ベース) です。

FactSet Global Robotics & Automation Indexとは、当社がFactSet UK Limitedと共同開発したスマートベータ指数^(※1)で、世界のロボット関連企業^(※2)の中から総資産に占める売上総利益の割合(売上総利益÷総資産)の原則上位50銘柄で構成される指数です。

- ・構成銘柄の入替は年1回、ウェイトのリバランスは年2回行います。

- ・構成銘柄のウェイトは浮動株調整後の時価総額基準とし、リバランス時の1銘柄のウェイトは最大5%とします。

※1 スマートベータ指数とは、個別銘柄の株価の単純平均結果又は時価総額による加重平均結果に基づく従来から存在する指数とは異なり、個別銘柄の株価や財務指標に関する分析結果等、指数の構成銘柄や構成比率の決定時に個別銘柄に関する特定の要素を勘案したうえで算出される指数をいいます。このため、スマートベータ指数は必ずしも市場全体の平均や値動きを示す指数ではありません。

※2 ロボット関連企業とは、売上の50%超がロボット関連事業(オートメーション関連事業を含みます。)から得ている企業を言います。

「税引後配当込み」指数は、税引後の配当収益を考慮して算出した指数です。

「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

FactSet UK Limited及びその関連会社(以下「FactSet」)は、当ファンドの支援、保証、販売もしくは販売促進をしているわけではありません。FactSetは、明示又は黙示を問わず、当ファンドの所有者もしくはいかなる一般人に対して、株式全般又は特に当ファンドへの投資の妥当性、もしくは全般的な株式市場のパフォーマンスを追従する当インデックスの能力に関して、一切の表明もしくは保証をしていません。FactSetは当インデックスの決定、構成、又は計算において、当社もしくは当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。FactSetと当社との間にある唯一の関係は、当社又は当ファンドに関係なくFactSetによって決定・構成・計算される当インデックスもしくはFactSetの特定の商標及び商標名のライセンス供与です。FactSetは、当ファンドの価格もしくは金額の決定、新規設定又は販売のタイミングの決定、又は換金される計算式の決定に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。FactSetは、インデックスの運営、マーケティング又は取引に関連する義務又は責任を負いません。

FactSetは、FactSet Global Robotics & Automation Indexの正確性及び、又は完全性を保証するものではありません。また、その中に含まれるデータ及びインデックス使用許諾者は、いかなる誤り、欠落又は中断について責任を負うものではありません。FactSetは、インデックスの使用許諾者、当ファンドの所有者、又は当インデックス又はそれに含まれるすべてのデータの使用に起因する他の人物又は組織によって得られる結果について、明示的又は黙示的に保証されるものではありません。FactSetは、明示的又は黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックス又はそれに含まれるすべてのデータの商品性、特定の目的又は使用への適合性について、一切の保証を明示的に否認します。これに限定されず、FactSetは、たとえそのような損害の可能性について知らされていたとしても、特別損害、懲罰的損害、間接的損害又は派生的損害(逸失利益を含む)に対する責任を一切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。

当期中の基準価額と市況の推移

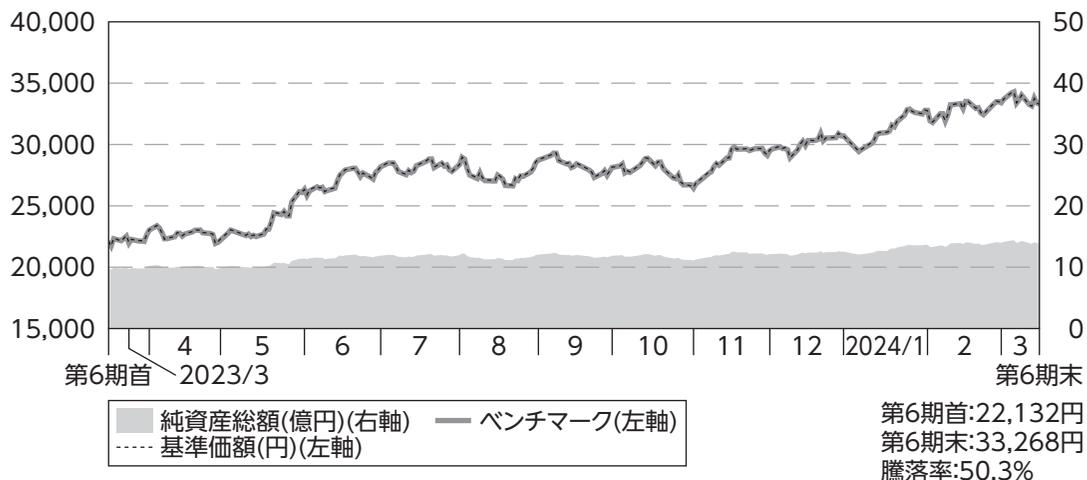
年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率					
(当 期 首) 2023年 3月15日	22,132	—	22,077	—	97.2	2.4	—	—	
3月末	23,061	4.2	22,971	4.1	97.1	2.4	—	—	
4月末	22,314	0.8	22,149	0.3	97.1	2.5	—	—	
5月末	26,333	19.0	26,277	19.0	98.7	1.1	—	—	
6月末	28,187	27.4	28,114	27.3	98.3	1.5	—	—	
7月末	28,369	28.2	28,287	28.1	98.1	1.1	—	—	
8月末	28,791	30.1	28,664	29.8	97.4	1.9	—	—	
9月末	28,159	27.2	28,062	27.1	96.8	2.6	—	—	
10月末	26,499	19.7	26,389	19.5	97.3	2.3	—	—	
11月末	29,563	33.6	29,432	33.3	98.4	0.4	—	—	
12月末	30,695	38.7	30,633	38.8	96.9	2.7	—	—	
2024年 1月末	32,753	48.0	32,697	48.1	94.9	4.6	—	—	
2月末	33,405	50.9	33,322	50.9	94.4	5.4	—	—	
(当 期 末) 2024年 3月15日	33,268	50.3	33,194	50.4	94.8	5.1	—	—	

(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

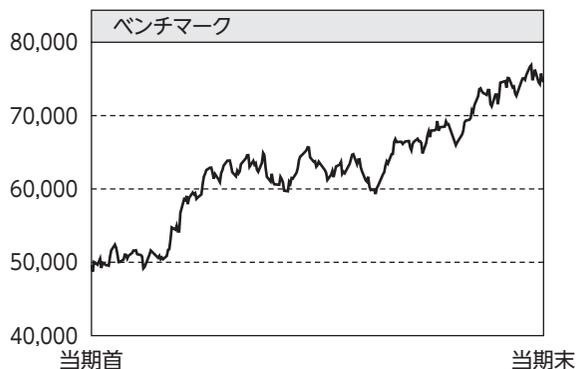


(注)ベンチマークは、2023年3月15日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるFactSet Global Robotics & Automation Index(税引後配当込み、円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。堅調な経済指標や好調な企業業績を背景にしたソフトランディング期待やAI関連市場への成長期待から株式市場が上昇する中、個別銘柄としては、エヌビディア(米国、半導体・半導体製造装置)、ハブスポット(米国、ソフトウェア・サービス)などが大きく上昇し基準価額に対してプラスに寄与しました。

投資環境



グローバル株式市場は上昇しました。期初は金融システム不安が広がりましたが、米当局の迅速な対応により過度な懸念が後退し上昇に転じました。4月～7月は好調な企業業績や堅調な米国経済指標を背景にソフトランディング期待が広がり続伸しました。8月以降は米国の金融引き締め継続が懸念された他、地政学リスクの高まりから投資家心理が悪化し下落に転じました。11月以降はインフレ指標の鈍化を受け、翌年の早期利下げ期待が高まり上昇しました。2024年以降はインフレ指標の高止まりによる利下げ開始時期の先送りが予想されるもののAI関連市場への成長期待やソフトランディング期待により堅調に推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるFactSet Global Robotics & Automation Index (税引後配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む世界の株式を高位に組み入れ運用を行いました。なお、先物はヘッジ目的で利用しました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、個別銘柄の構成比をベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

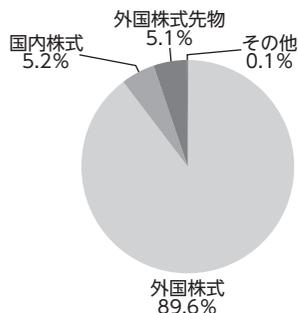
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	NVIDIA CORP	アメリカ	7.2%
2	HUBSPOT INC	アメリカ	6.0%
3	INTUITIVE SURGICAL INC	アメリカ	5.6%
4	QUALCOMM	アメリカ	5.6%
5	NASD100 MICR 2406	アメリカ	5.1%
6	AUTODESK INC	アメリカ	4.9%

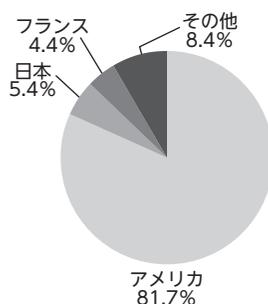
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	PTC INC	アメリカ	4.9%
8	ON SEMICONDUCTOR CORP	アメリカ	4.7%
9	CADENCE DESIGN SYSTEMS	アメリカ	4.7%
10	ROCKWELL AUTOMATION INC	アメリカ	4.4%
組入銘柄数			48

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

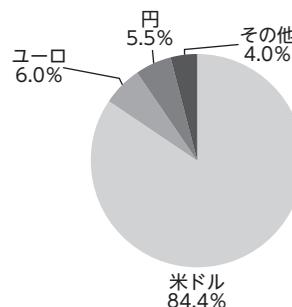
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

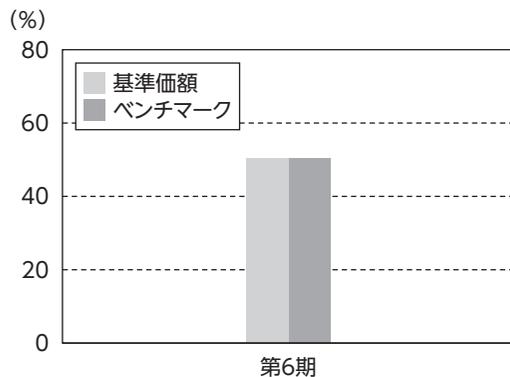


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して5.1%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、プラスの影響としては先物要因※、マイナスの影響としてはキャッシュ要因などです。

※取引コスト低減のために利用している先物とベンチマークとのリターン差による乖離要因。

今後の運用方針

主として日本を含む世界各国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)に投資し、FactSet Global Robotics & Automation Index(税引後配当込み、円換算ベース)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3月16日~2024年3月15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)	4円 (3) (-) (-) (-) (-) (-) (1)	0.013% (0.011) (-) (-) (-) (-) (-) (0.002)	(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)	5 (5) (-) (-) (-) (-) (-)	0.019 (0.019) (-) (-) (-) (-) (-)	(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)	28 (28) (-) (0)	0.099 (0.099) (-) (0.000)	(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	37	0.131	

(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(28,177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 1	千円 6,514	千株 4	千円 18,235
外	ア メ リ カ	百株 226	千米ドル 2,016	百株 237	千米ドル 2,938
	ド イ ツ	13	千ユーロ 98	—	千ユーロ —
	フ ラ ン ス	98	400	12	39
	イ ギ リ ス	—	千イギリスポンド —	28	千イギリスポンド 106
国	ス イ ス	0.41	千スイスフラン 81	0.29	千スイスフラン 39
	台 湾	5	千新台幣ドル 825	99	千新台幣ドル 2,214

(注) 金額は受渡代金です。

<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
外国	株 式 先 物 取 引	百万円 264	百万円 229	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	877,754千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,154,174千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	0.76

(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	%
為 替 直 物 取 引	191	177	92.7	247	233	94.3
金 銭 信 託	0.012009	0.012009	100.0	0.011951	0.011951	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	759	52	6.9	754	52	6.9

(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。

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)
電気機器 (60.0%)			
オムロン	4.9	4.5	24,525
I D E C	—	0.7	1,912
横河電機	6.3	5	16,545
精密機器 (5.3%)			
トプコン	2.2	2.2	3,839
情報・通信業 (14.8%)			
日本オラクル	0.9	0.9	10,584

銘 柄	当 期 首 (前 期 末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
卸売業 (19.9%)			
ミスミグループ本社	8.1	6.5	14,235
合 計	株 数 ・ 金 額	22	71,640
	銘柄数 < 比率 >	5	< 5.2% >

(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。

※ 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。

<外国株式>

銘柄	当期末(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
ADVANCED MICRO DEVICES	45	—	—	—	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	9	6	350	52,129	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	14	17	455	67,648	ソフトウェア・サービス
FARO TECHNOLOGIES INC	6	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	47	45	186	27,780	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CADENCE DESIGN SYSTEMS	19	14	435	64,706	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	20	7	669	99,444	半導体・半導体製造装置
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	38	35	274	40,728	半導体・半導体製造装置
SILICON LABORATORIES INC	—	7	96	14,341	半導体・半導体製造装置
ON SEMICONDUCTOR CORP	—	56	438	65,107	半導体・半導体製造装置
PEGASYS INC	12	8	50	7,543	ソフトウェア・サービス
QUALCOMM	27	31	524	77,868	半導体・半導体製造装置
RAMBUS INC	—	26	158	23,562	半導体・半導体製造装置
ROCKWELL AUTOMATION INC	11	14	412	61,326	資本財
KADANT INC	—	2	79	11,769	資本財
PDF SOLUTIONS INC	—	8	27	4,011	半導体・半導体製造装置
SYNOPSYS INC	9	7	391	58,175	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	—	13	526	78,290	ヘルスケア機器・サービス
CEVA INC	6	6	13	2,070	半導体・半導体製造装置
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	16	15	131	19,556	ソフトウェア・サービス
IROBOT CORP	7	7	6	985	耐久消費財・アパレル
PROS HOLDINGS INC	—	12	41	6,212	ソフトウェア・サービス
TERADATA CORP	25	25	98	14,572	ソフトウェア・サービス
MAXLINEAR INC	18	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	38	25	394	58,627	ソフトウェア・サービス
AMBARELLA INC	9	9	48	7,178	半導体・半導体製造装置
PTC INC	24	24	453	67,444	ソフトウェア・サービス
ALTAIR ENGINEERING INC - A	13	14	119	17,807	ソフトウェア・サービス
ELASTIC NV	22	21	216	32,204	ソフトウェア・サービス
DOMO INC - CLASS B	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A	72	60	145	21,604	ソフトウェア・サービス
VIMEO INC	38	38	20	3,020	メディア・娯楽
SPRINKLR INC-A	17	32	44	6,632	ソフトウェア・サービス
CONCENTRIX CORP	12	—	—	—	商業・専門サービス
FRESHWORKS INC-CL A	—	35	63	9,376	ソフトウェア・サービス
HUBSPOT INC	10	8	559	83,128	ソフトウェア・サービス
GODADDY INC - CLASS A	44	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ALTRIX INC - CLASS A	17	12	59	8,768	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 銘柄 数	662 30	651 32	7,494 —	1,113,626 <80.3%>
(ドイツ)			千ユーロ		
NEMETSCHEK SE	—	13	113	18,392	ソフトウェア・サービス
国 小 計	株 数 銘柄 数	— 1	13 1	113 —	18,392 <1.3%>
(フランス)					
DASSAULT SYSTEMES SA	—	86	361	58,398	ソフトウェア・サービス
国 小 計	株 数 銘柄 数	— 1	86 1	361 —	58,398 <4.2%>
ユーロ計	株 数 銘柄 数	— 2	99 2	474 —	76,791 <5.5%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
SPECTRIS PLC	28	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	株 数 銘柄 数	28 1	— —	— —	— <—%>

銘柄	株数 (百株)	当期 株数 (百株)	期末		業種
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(スイス)			千スイスフラン		
INFICON HOLDING AG-REG	0.66	0.65	84	14,148	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INTERROLL HOLDING AG-REG	—	0.13	36	6,146	資本財
KARDEX HOLDING AG-REG	1	1	32	5,525	資本財
小計	1	2	153	25,820	
	株数・金額 銘柄数<比率>	2	3	—	<1.9%>
(台湾)			千新台幣ドル		
FARADAY TECHNOLOGY CORP	55	55	1,991	9,381	半導体・半導体製造装置
HOLTEK SEMICONDUCTOR INC	30	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PIXART IMAGING INC	40	—	—	—	半導体・半導体製造装置
GLOBAL UNICHIP CORP	22	22	2,948	13,891	半導体・半導体製造装置
NUVOTON TECHNOLOGY CORP	50	50	612	2,886	半導体・半導体製造装置
AP MEMORY TECHNOLOGY CORP	24	—	—	—	半導体・半導体製造装置
小計	221	127	5,551	26,159	
	株数・金額 銘柄数<比率>	6	3	—	<1.9%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
MAYTRONICS LTD	6	6	22	934	耐久消費財・アパレル
小計	6	6	22	934	
	株数・金額 銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>
合計	919	885	—	1,243,331	
	株数・金額 銘柄数<比率>	40	41	—	<89.6%>

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >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	期末	
		当 買 建 額 (百万円)	末 売 建 額 (百万円)
外国	NASD100 MICR	70	—

(注) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

投資信託財産の構成

項目	期末	
	当 評 価 額 千円	末 比 率 %
株 式	1,314,972	94.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	72,719	5.2
投 資 信 託 財 産 総 額	1,387,691	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(1,310,735千円)の投資信託財産総額(1,387,691千円)に対する比率は94.5%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=148.59円

1ユーロ=161.68円

1イギリスポンド=189.30円

1スイスフラン=167.96円

1ノルウェークローネ=14.03円

1オーストラリアドル=97.62円

1新台幣ドル=4.7122円

1イスラエルシェケル=40.645円

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3月15日現在
(A)資 産	1,387,691,503円
コール・ローン等	59,988,700
株 式(評価額)	1,314,972,200
未 収 入 金	198,144
未 収 配 当 金	383,007
差 入 委 託 証 拠 金	12,149,452
(B)負 債	418,155
未 払 解 約 金	418,155
(C)純 資 産 総 額(A-B)	1,387,273,348
元 本	417,004,447
次 期 繰 越 損 益 金	970,268,901
(D)受 益 権 総 口 数	417,004,447口
1万口当たり基準価額(C/D)	33,268円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年3月16日 至 2024年3月15日
(A)配 当 等 収 益	5,774,137円
受 取 配 当 金	4,571,861
受 取 利 息	834,102
そ の 他 収 益 金	369,352
支 払 利 息	△1,178
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	459,594,203
売 買 益	519,859,544
売 買 損	△60,265,341
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	9,341,244
取 引 益	9,758,069
取 引 損	△416,825
(D)そ の 他 費 用	△1,210,492
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	473,499,092
(F)前 期 繰 越 損 益 金	536,455,531
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	99,855,971
(H)解 約 差 損 益 金	△139,541,693
(I)計 (E+F+G+H)	970,268,901
次 期 繰 越 損 益 金(I)	970,268,901

(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442,195,513円、期中追加設定元本額は52,734,958円、期中一部解約元本額は77,926,024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 MIRAIIndex ロボ
SMT MIRAIIndex 総合

405,377,342円
11,627,105円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年7月27日)