

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／海外／株式／インデックス型	
信 託 期 間	信託期間は2025年7月31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 ラッセル3000 全米株式インデックス (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。
	ラッセル1000 インデックス マザーファンド	米国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
	ラッセル2000 インデックス マザーファンド	米国の金融商品取引所等に上場している中小型株式を主要投資対象とします。
組 入 制 限	My SMT ラッセル3000 全米株式インデックス (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。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 為替予約取引は、ヘッジ目的に限定します。 デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定します。
	ラッセル1000 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。 為替予約取引は、ヘッジ目的に限定します。 デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定します。
	ラッセル2000 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。 為替予約取引は、ヘッジ目的に限定します。 デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定します。
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 ラッセル3000全米株式 インデックス(ノーロード)

運 用 報 告 書 (全 体 版)

第1期（決算日 2026年6月22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。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・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。

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			ベンチマーク		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税 込 分配金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率				
設定日 (2025年7月31日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	百万円 0.5
第1期 (2026年6月22日)	12,737	0	27.4	12,828	28.3	—	7.2	92.2	171

(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 率	株 式 先 物 率	投資信託 証券 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率			
(設 定 日) 2025年 7月31日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —	% —
7月末	10,000	0.0	10,000	0.0	—	—	—
8月末	10,026	0.3	10,032	0.3	—	4.9	95.6
9月末	10,399	4.0	10,416	4.2	—	9.5	90.0
10月末	10,989	9.9	11,009	10.1	—	8.7	91.1
11月末	11,174	11.7	11,198	12.0	—	8.3	91.3
12月末	11,321	13.2	11,358	13.6	—	8.1	91.8
2026年 1月末	11,229	12.3	11,278	12.8	—	7.6	92.4
2月末	11,329	13.3	11,375	13.8	—	7.5	91.7
3月末	10,675	6.8	10,720	7.2	—	7.4	91.9
4月末	12,007	20.1	12,065	20.7	—	7.2	92.1
5月末	12,631	26.3	12,714	27.1	—	7.2	92.0
(当 期 末) 2026年 6月22日	12,737	27.4	12,828	28.3	—	7.2	92.2

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。
(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」です。

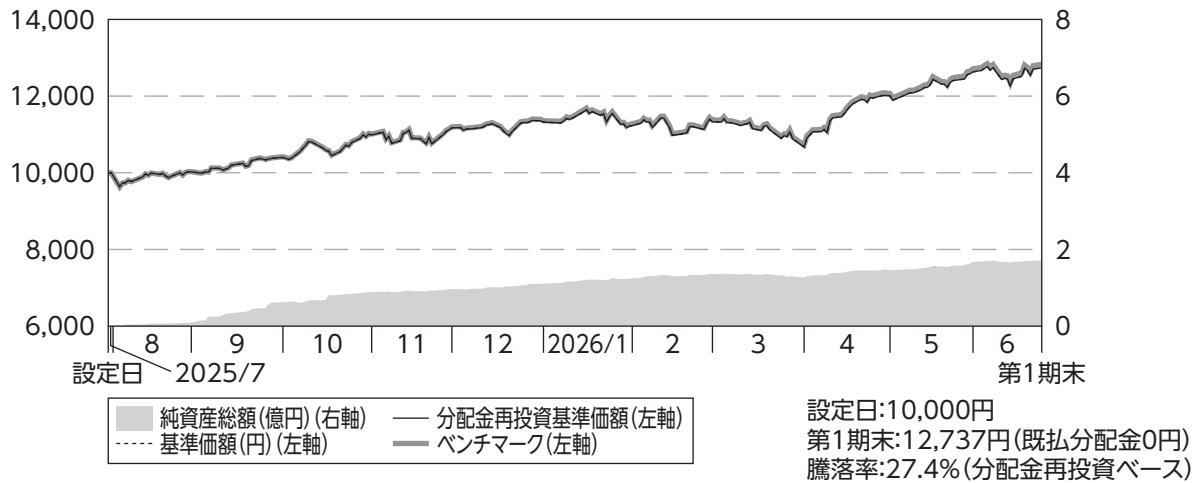
ベンチマークは、Russell 3000® Index（配当込み、円換算ベース）です。
Russell 3000® Indexとは、FTSE Russellが公表している米国の株価指数で、時価総額上位約3,000銘柄を時価総額で加重平均して算出されます。
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。
「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

FTSE RussellはLondon Stock Exchange Group plc及びそのグループ会社（以下、総称して「LSEグループ」といいます。）の会社の商号です。「FTSE Russell®」は、LSEグループの関連会社の商標であり、他のLSEグループ会社がライセンスに基づき使用しています。FTSE Russellの指数またはデータに関する全ての権利は、当該指数又はデータを所有するLSEグループ各社に帰属します。LSEグループおよび指数所有者は、指数またはデータの誤謬または脱漏についていかなる責任も負わず、いかなる当事者も本件取り組みに含まれる指数またはデータに依拠することはできません。関係するLSEグループの会社の書面による明示的な同意なしに、LSEグループのデータを配布することはできません。LSEグループは、本件取り組みの内容を販売促進、支援、保証する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。

（出典）LSEグループ

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、2025年7月31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Russell 3000® Index (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。

組入ファンド	投資資産	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
ラッセル1000インデックスマザーファンド	米国株式等	94.8%	31.7%
ラッセル2000インデックスマザーファンド	米国の中小型株式等	4.7%	45.3%

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

投資環境

米国株式市場は、米CPI(消費者物価指数)が概ね市場の予想通りとなり物価上昇への過度な警戒感が和らいだことや、ジャクソンホール会議でFRB(米連邦準備理事会)議長が利下げの可能性を示唆したことなどから上昇しました。その後も、米国の7-9月期のGDP(国内総生産)成長率が市場予想を大幅に上回ったことなどから堅調に推移しました。2026年3月には中東紛争の緊迫化懸念からリスク回避姿勢が強まったことや、インフレ再加速への警戒からFRBによる利下げ期待が後退したことなどから下落しましたが、期末にかけては米国とイランの一時停戦合意を受けて軍事衝突の終結期待が高まったことや、原油価格の下落を受けて米長期金利が低下に転じたことなどから上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

「ラッセル1000インデックスマザーファンド」受益証券、「ラッセル2000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、ベンチマークであるRussell 3000® Index(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。

【「ラッセル1000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Russell 1000® Index(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。

ポートフォリオの構築に際しては、ETF(上場投資信託証券)および先物を組み入れ、組入比率を高位に維持しました。なお、先物はヘッジ目的で利用しました。

【「ラッセル2000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Russell 2000® Index(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。

ポートフォリオの構築に際しては、ETF(上場投資信託証券)および先物を組み入れ、組入比率を高位に維持しました。なお、先物はヘッジ目的で利用しました。

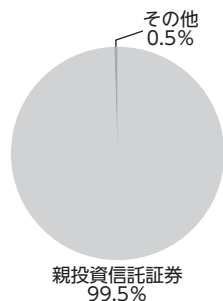
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

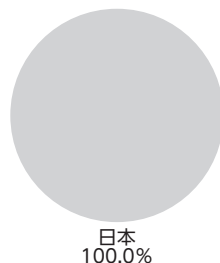
	当期末
	2026年6月22日
ラッセル1000インデックスマザーファンド	94.8%
ラッセル2000インデックスマザーファンド	4.7%
その他	0.5%
組入ファンド数	2

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

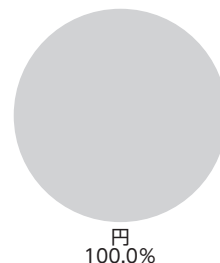
○資産別配分



○国別配分



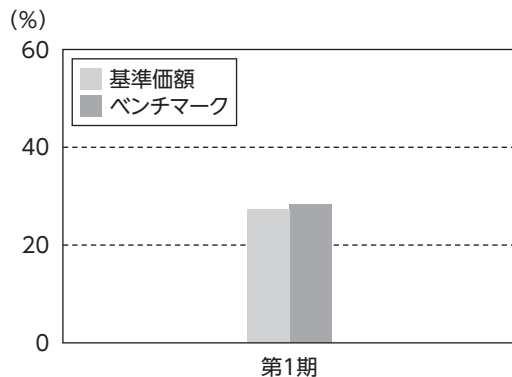
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額（分配金込み）とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、信託報酬要因、先物要因、ETF要因、キャッシュ要因、取引コスト要因（いずれもマイナス要因）などです。

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1期
		2025年7月31日~2026年6月22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)	2,736

(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。

○当ファンド

下記のマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、Russell 3000® Index (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。

・ラッセル1000インデックスマザーファンド

主として米国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、Russell 1000® Index (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。

株式への投資割合は、原則として高位を維持します。なお、投資信託財産の規模によっては、運用効率の観点から、株式に代えてRussell 1000® Indexへの連動を目指す上場投資信託証券に投資することがあります。

・ラッセル2000インデックスマザーファンド

主として米国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、Russell 2000® Index (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。

株式への投資割合は、原則として高位を維持します。なお、投資信託財産の規模によっては、運用効率の観点から、株式に代えてRussell 2000® Indexへの連動を目指す上場投資信託証券に投資することがあります。

1万口当たりの費用明細

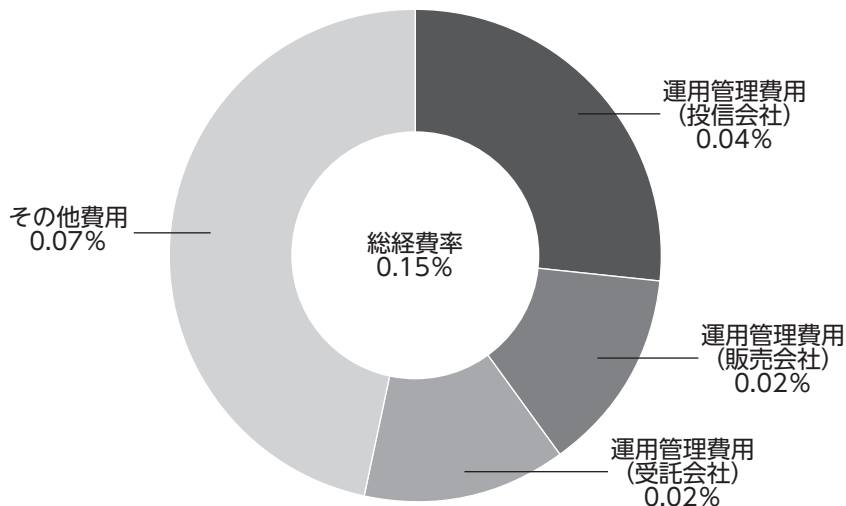
項目	当期		項目の概要
	(2025年7月31日～2026年6月22日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	9円	0.077%	(a) 信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,070円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(4)	(0.035)	
(販売会社)	(2)	(0.022)	
(受託会社)	(2)	(0.020)	
(b) 売買委託手数料	2	0.015	(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)	(－)	(－)	
(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)	(1)	(0.011)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(0)	(0.004)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(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)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	7	0.064	(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)	(6)	(0.058)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	18	0.156	

- (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0.15%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)実質的に投資する上場投資信託証券の運用・管理にかかる費用は含みません。

(注5)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
ラッセル1000インデックス マザーファンド	千口 138,220	千円 153,296	千口 13,494	千円 15,392
ラッセル2000インデックス マザーファンド	6,165	7,109	556	672

株式売買比率

当期中における該当事項はありません。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.000026	百万円 0.000026	% 100.0	百万円 0.000026	百万円 0.000026	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	248	21	8.5	247	21	8.5

(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。

<ラッセル1000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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 478	百万円 19	% 4.0	百万円 58	百万円 －	% －
金 銭 信 託	0.000161	0.000161	100.0	0.000161	0.000161	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,105	95	8.6	1,109	95	8.6

<平均保有割合 12.0%>
(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。

<ラッセル2000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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 1,283	百万円 93	% 7.2	百万円 371	百万円 186	% 50.1
金 銭 信 託	0.000273	0.000273	100.0	0.000273	0.000273	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	2,454	214	8.7	2,444	213	8.7

<平均保有割合 0.6%>
(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。

自社による当ファンドの設定・解約状況

当 期 首 残 高 本 (元)	当 期 設 定 本 元	当 期 解 約 本 元	当 期 末 残 高 本 (元)	取 引 の 理 由
千円 －	千円 500	千円 500	千円 －	当初設定時における取得およびその解約

組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	当 期	末
	口 数	評 価 額
	千口	千円
ラッセル1000インデックスマザーファンド	124,725	162,679
ラッセル2000インデックスマザーファンド	5,608	8,147

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、以下の通りです。

ラッセル1000インデックスマザーファンド	861,130千口
ラッセル2000インデックスマザーファンド	826,739千口

投資信託財産の構成

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
ラッセル1000インデックスマザーファンド	162,679	94.7
ラッセル2000インデックスマザーファンド	8,147	4.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	981	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	171,807	100.0

(注1)ラッセル1000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(1,122,341千円)の投資信託財産総額(1,126,331千円)に対する比率は99.6%です。

(注2)ラッセル2000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(1,190,766千円)の投資信託財産総額(1,200,995千円)に対する比率は99.1%です。

(注3)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＝161.60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 2026年6月22日現在
(A)資 産	171,807,068円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	979,729
ラッセル1000インデックス マザーファンド(評価額)	162,679,370
ラッセル2000インデックス マザーファンド(評価額)	8,147,944
未 収 利 息	25
(B)負 債	130,695
未 払 解 約 金	79,162
未 払 信 託 報 酬	48,471
そ の 他 未 払 費 用	3,062
(C)純 資 産 総 額(A-B)	171,676,373
元 本	134,790,110
次 期 繰 越 損 益 金	36,886,263
(D)受 益 権 総 口 数	134,790,110口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,737円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2025年7月31日 至 2026年6月22日
(A)配 当 等 収 益	5,270円
受 取 利 息	5,270
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	24,083,007
売 買 益	26,427,637
売 買 損	△2,344,630
(C)信 託 報 酬 等	△84,038
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	24,004,239
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	12,882,024
(配 当 等 相 当 額)	(8,386)
(売 買 損 益 相 当 額)	(12,873,638)
(F)計 (D+E)	36,886,263
(G)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	36,886,263
追 加 信 託 差 損 益 金	12,882,024
(配 当 等 相 当 額)	(199,382)
(売 買 損 益 相 当 額)	(12,682,642)
分 配 準 備 積 立 金	24,004,239

(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) (E)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500,000円、期中追加設定元本額は167,655,743円、期中一部解約元本額は33,365,633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)	1,141,302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)	22,862,937円
(C) 収益調整金額	12,882,024円
(D) 分配準備積立金額	－円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	36,886,263円
(F) 期末残存口数	134,790,110口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	2,736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

「一般社団法人投資信託協会」を、「一般社団法人資産運用業協会」に変更するため、投資信託約款に
所要の変更を行いました。

(変更日:2026年4月1日)

ラッセル1000インデックスマザーファンド

運用報告書

第1期（決算日 2025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2025年1月15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	米国の金融商品取引所等に上場し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割合には制限を設けません。 為替予約取引は、ヘッジ目的に限定します。 デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定します。

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。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・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。

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	ベンチマーク		株 式 組 入 率	株 式 先 比	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					
設定日 (2025年 1月15日)	円 10,000	% —	10,000	% —		% —	% —	百万円 199
第1期 (2025年10月20日)	10,831	8.3	10,866	8.7	—	9.0	90.9	733

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」です。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券 組入比率
	騰 落 率		騰 落 率						
(設 定 日) 2025年 1月15日	円 10,000	% —		% —		% —		% —	% —
1月末	10,076	0.8	10,091	0.9	—		13.6		86.7
2月末	9,408	△5.9	9,413	△5.9	—		12.1		88.1
3月末	8,941	△10.6	8,954	△10.5	—		11.1		88.7
4月末	8,509	△14.9	8,519	△14.8	—		9.8		90.4
5月末	9,145	△8.6	9,155	△8.4	—		9.6		90.1
6月末	9,599	△4.0	9,631	△3.7	—		4.8		94.9
7月末	10,223	2.2	10,248	2.5	—		4.9		95.0
8月末	10,290	2.9	10,319	3.2	—		4.9		96.0
9月末	10,677	6.8	10,714	7.1	—		9.5		90.2
(当 期 末) 2025年10月20日	10,831	8.3	10,866	8.7	—		9.0		90.9

(注1) 騰落率は設定日比です。

(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」です。

ベンチマークは、Russell 1000® Index（配当込み、円換算ベース）です。

Russell 1000® Indexとは、FTSE Russellが公表している米国の株価指数で、時価総額などを基準に選定した約1,000銘柄を時価総額で加重平均して算出されます。

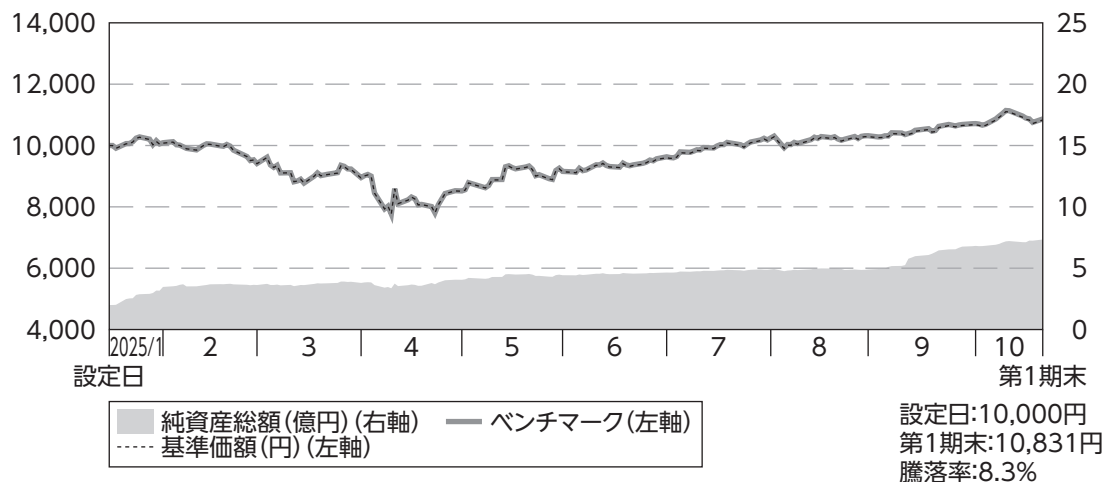
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

「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。

出典：London Stock Exchange Group plc及びそのグループ会社（以下、総称して「LSEグループ」といいます。）FTSE RussellはLSEグループの会社の商号です。「FTSE Russell®」は、LSEグループの関連会社の商標であり、他のLSEグループ会社がライセンスに基づき使用しています。FTSE Russellの指数またはデータに関する全ての権利は、当該指数又はデータを所有するLSEグループ各社に帰属します。LSEグループおよび指数所有者は、指数またはデータの誤謬または脱漏についていかなる責任も負わず、いかなる当事者も本件取り組みに含まれる指数またはデータに依拠することはできません。関係するLSEグループの会社の書面による明示的な同意なしに、LSEグループのデータを配布することはできません。LSEグループは、本件取り組みの内容を販売促進、支援、保証する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

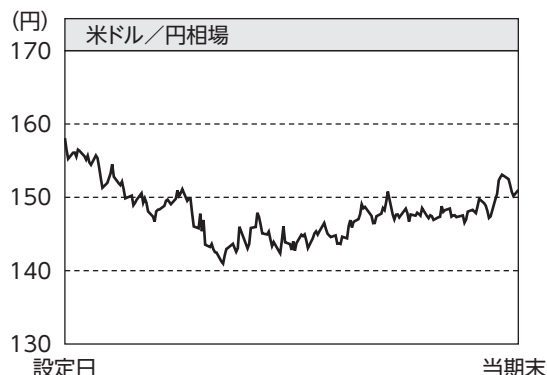


(注)ベンチマークは、2025年1月15日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるRussell 1000® Index (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。

投資環境



米国株式市場は、米物価指標が市場予想を下回ったことを受けて米インフレ再燃への過度な警戒感が和らいだほか、主要金融株の好決算などを背景に2025年2月にかけて堅調に推移しました。4月には米国の相互関税発表を受けて中国が報復措置を発表したことで報復合戦への警戒感が高まり一時急落しましたが、その後は米財務長官やトランプ米大統領の米中貿易摩擦の緩和を見込む発言などを受けて過度な警戒感が後退し、反発しました。5月以降も、日米の関税交渉合意を受けて米国と主要な貿易相手国との通商合意が進展するとの期待が高まったことやFOMC(米連邦公開市場委員会)での年末の政策金利見通しから連続利下げが示唆されたことなどを背景に上昇し、高値圏で期末を迎えました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるRussell 1000® Index(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。

ポートフォリオの構築に際しては、ETF(上場投資信託証券)および先物を組み入れ、組入比率を高位に維持しました。なお、先物はヘッジ目的で利用しました。

当ファンドの組入資産の内容

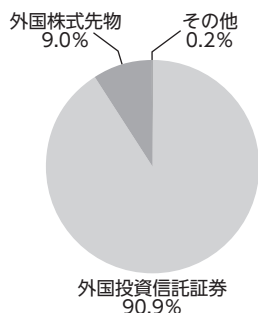
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ISHARES RUSSELL 1000 ETF	アメリカ	90.9%
2	SP500 MIC EM 2512	アメリカ	9.0%
3	———	—	—
4	———	—	—
5	———	—	—
6	———	—	—

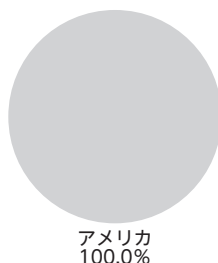
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	———	—	—
8	———	—	—
9	———	—	—
10	———	—	—
組入銘柄数		2	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

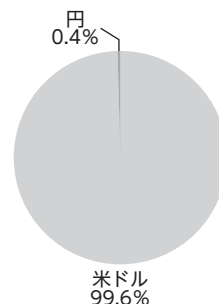
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

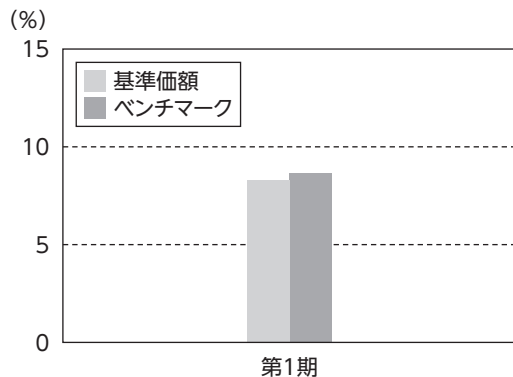


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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9.0%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、先物要因、取引コスト要因(いずれもマイナス要因)などです。

今後の運用方針

主として米国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、Russell 1000® Index (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。

株式への投資割合は、原則として高位を維持します。なお、投資信託財産の規模によっては、運用効率の観点から、株式に代えてRussell 1000® Indexへの連動を目指す上場投資信託証券に投資することがあります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2025年1月15日～2025年10月20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) (－) (0)	0.037% (－) (－) (－) (－) (0.033) (－) (0.004)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(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)	0 (－) (－) (－) (－) (－) (0)	0.000 (－) (－) (－) (－) (－) (0.000)	(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)	7 (7) (－) (0)	0.071 (0.069) (－) (0.002)	(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	0.108	

(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(9,652円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜投資信託受益証券、投資証券＞

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国					
	アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	ISHARES RUSSELL 1000 ETF	13	4,356	0.95	324
	小 計	13	4,356	0.95	324

(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 214	百万円 149	百万円 －	百万円 －

(注) 金額は受渡代金です。

株式売買比率

当期中における該当事項はありません。

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.000186	百万円 0.000186	% 100.0	百万円 0.000186	百万円 0.000186	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,217	157	12.9	1,215	157	12.9

(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

＜外国投資信託受益証券、投資証券＞

銘 柄		口 数 (千口)	当 期 末	
			評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(アメリカ)			千米ドル	
ISHARES RUSSELL 1000 ETF		12	4,416	666,821
合 計	口 数 ・ 金 額	12	4,416	666,821
	銘 柄 数 <比 率>	1	—	<90.9%>

(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		当 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国	SP500 MIC EM	65	—

(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	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	666,821	90.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	66,900	9.1
投 資 信 託 財 産 総 額	733,721	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(730,570千円)の投資信託財産総額(733,721千円)に対する比率は99.6%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＝151.00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 2025年10月20日現在
(A) 資 産	739,140,956円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	54,031,435
投資信託受益証券(評価額)	666,821,497
未 収 入 金	6,310,904
未 収 利 息	31
差 入 委 託 証 拠 金	11,977,089
(B) 負 債	5,419,464
未 払 金	5,419,464
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	733,721,492
元 本	677,441,919
次 期 繰 越 損 益 金	56,279,573
(D) 受 益 権 総 口 数	677,441,919口
1万口当たり基準価額 (C/D)	10,831円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2025年 1月15日 至 2025年10月20日
(A) 配 当 等 収 益	4,019,632円
受 取 配 当 金	3,201,522
受 取 利 息	576,511
そ の 他 収 益 金	241,599
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	53,187,542
売 買 益	58,125,705
売 買 損	△4,938,163
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	2,911,619
取 引 益	5,168,692
取 引 損	△2,257,073
(D) そ の 他 費 用	△317,201
(E) 当 期 損 益 金 (A+B+C+D)	59,801,592
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△3,785,191
(G) 解 約 差 損 益 金	263,172
(H) 計 (E+F+G)	56,279,573
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	56,279,573

(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199,900,000円、期中追加設定元本額は538,894,485円、期中一部解約元本額は61,352,566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。

My SMT ラッセル1000米国株式インデックス(ノーロード)

605,576,832円

My SMT ラッセル3000全米株式インデックス(ノーロード)

71,865,087円

お知らせ

「投資信託及び投資法人に関する法律」第14条の改正に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2025年4月1日)

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。

本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。

今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。

ラッセル2000インデックスマザーファンド

運用報告書

第1期（決算日 2026年6月22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2025年7月31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	米国の金融商品取引所等に上場している中小型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割合には制限を設けません。 為替予約取引は、ヘッジ目的に限定します。 デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定します。

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。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・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。

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 円	騰 落 率 %	ベンチマーク 10,000	騰 落 率 %	株 組 比 —	式 入 率 —	株 先 比 9.9	式 物 率 89.6	投資信託 証券組入比率 —	純 資 産 額 百万円 199
設定日 (2025年7月31日)	10,000	—	10,000	—	—	—	—	—	—	—
第1期 (2026年6月22日)	14,527	45.3	14,603	46.0	—	—	9.9	89.6	—	1,200

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」です。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額 円	騰 落 率 %	ベンチマーク 10,000	騰 落 率 %	株 組 比 —	式 入 率 —	株 先 比 9.9	式 物 率 89.6	投資信託 証券組入比率 —
(設 定 日) 2025年 7月31日	10,000	—	10,000	—	—	—	—	—	—
7月末	10,000	0.0	10,000	0.0	—	—	—	—	—
8月末	10,492	4.9	10,490	4.9	—	—	5.5	97.3	—
9月末	10,895	9.0	10,897	9.0	—	—	10.4	89.4	—
10月末	11,426	14.3	11,432	14.3	—	—	9.3	90.0	—
11月末	11,727	17.3	11,726	17.3	—	—	9.2	90.2	—
12月末	11,876	18.8	11,895	19.0	—	—	7.5	92.4	—
2026年 1月末	12,278	22.8	12,310	23.1	—	—	9.8	89.5	—
2月末	12,577	25.8	12,598	26.0	—	—	9.2	90.3	—
3月末	11,644	16.4	11,673	16.7	—	—	9.4	90.1	—
4月末	13,263	32.6	13,300	33.0	—	—	8.9	90.9	—
5月末	14,132	41.3	14,181	41.8	—	—	9.7	89.5	—
(当 期 末) 2026年 6月22日	14,527	45.3	14,603	46.0	—	—	9.9	89.6	—

(注1) 騰落率は設定日比です。

(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」です。

ベンチマークは、Russell 2000® Index（配当込み、円換算ベース）です。

Russell 2000® Indexとは、FTSE Russellが公表している米国の株価指数で、時価総額順位1,001位から3,000位の中小型銘柄を時価総額で加重平均して算出されます。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

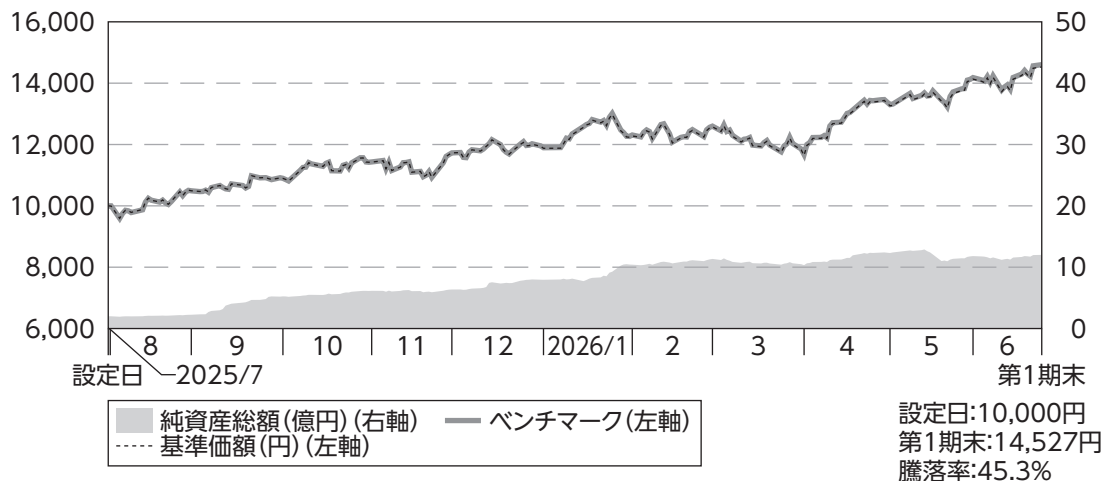
「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

FTSE RussellはLondon Stock Exchange Group plc及びそのグループ会社（以下、総称して「LSEグループ」といいます。）の会社の商号です。「FTSE Russell®」は、LSEグループの関連会社の商標であり、他のLSEグループ会社がライセンスに基づき使用しています。FTSE Russellの指数またはデータに関する全ての権利は、当該指数又はデータを所有するLSEグループ各社に帰属します。LSEグループおよび指数所有者は、指数またはデータの誤謬または脱漏についていかなる責任も負わず、いかなる当事者も本件取り組みに含まれる指数またはデータに依拠することはできません。関係するLSEグループの会社の書面による明示的な同意なしに、LSEグループのデータを配布することはできません。LSEグループは、本件取り組みの内容を販売促進、支援、保証する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。

（出典）LSEグループ

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、2025年7月31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Russell 2000® Index (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。

投資環境

米国株式市場は、米CPI(消費者物価指数)が概ね市場の予想通りとなり物価上昇への過度な警戒感が和らいだことや、ジャクソンホール会議でFRB(米連邦準備理事会)議長が利下げの可能性を示唆したことなどから上昇しました。その後も、米国の7-9月期のGDP(国内総生産)成長率が市場予想を大幅に上回ったことなどから堅調に推移しました。2026年3月には中東紛争の緊迫化懸念からリスク回避姿勢が強まったことや、インフレ再加速への警戒からFRBによる利下げ期待が後退したことなどから下落しましたが、期末にかけては米国とイランの一時停戦合意を受けて軍事衝突の終結期待が高まったことや、原油価格の下落を受けて米長期金利が低下に転じたことなどから上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるRussell 2000® Index(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。

ポートフォリオの構築に際しては、ETF(上場投資信託証券)および先物を組み入れ、組入比率を高位に維持しました。なお、先物はヘッジ目的で利用しました。

当ファンドの組入資産の内容

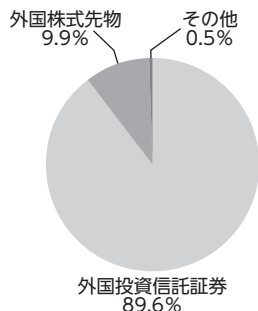
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	VANGUARD RUSSELL 2000 ETF	アメリカ	89.6%
2	RUSS2000MICR 2609	アメリカ	9.9%
3	――	――	――
4	――	――	――
5	――	――	――
6	――	――	――

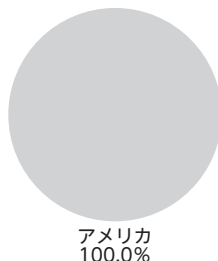
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	――	――	――
8	――	――	――
9	――	――	――
10	――	――	――
組入銘柄数			2

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

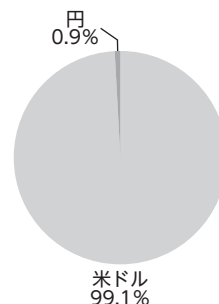
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

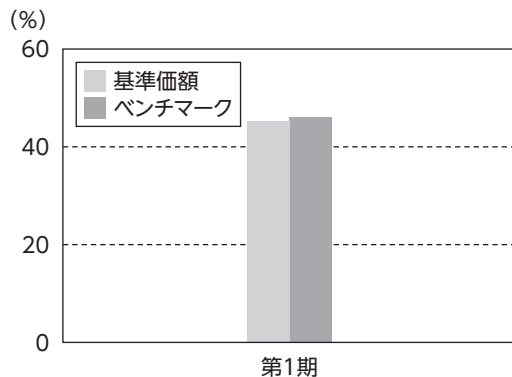


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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9.9%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、先物要因、キャッシュ要因、取引コスト要因(いずれもマイナス要因)などです。

今後の運用方針

主として米国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、Russell 2000® Index (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。

株式への投資割合は、原則として高位を維持します。なお、投資信託財産の規模によっては、運用効率の観点から、株式に代えてRussell 2000® Indexへの連動を目指す上場投資信託証券に投資することがあります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2025年7月31日～2026年6月22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)	8円 (－) (－) (－) (－) (7) (－) (1)	0.070% (－) (－) (－) (－) (0.063) (－) (0.007)	(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)	0 (－) (－) (－) (－) (0)	0.000 (－) (－) (－) (－) (0.000)	(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)	6 (6) (－) (0)	0.054 (0.052) (－) (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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	14	0.124	

(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(11,846円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜投資信託受益証券、投資証券＞

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国				
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
VANGUARD RUSSELL 2000 ETF	76	7,636	20	2,227
小 計	76	7,636	20	2,227

(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 421	百万円 327	百万円 －	百万円 －

(注) 金額は受渡代金です。

株式売買比率

当期中における該当事項はありません。

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 1,283	百万円 93	% 7.2	百万円 371	百万円 186	% 50.1
金 銭 信 託	0.000273	0.000273	100.0	0.000273	0.000273	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	2,454	214	8.7	2,444	213	8.7

(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

＜外国投資信託受益証券、投資証券＞

銘 柄		口 数 (千口)	当 期 末	
			評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(アメリカ)			千米ドル	
VANGUARD RUSSELL 2000 ETF		55	6,659	1,076,109
合 計	口 数 ・ 金 額	55	6,659	1,076,109
	銘 柄 数 <比 率>	1	—	<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		当 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国	RUSS2000MICR	118	—

(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	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	1,076,109	89.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	124,886	10.4
投 資 信 託 財 産 総 額	1,200,995	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(1,190,766千円)の投資信託財産総額(1,200,995千円)に対する比率は99.1%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=161.60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 2026年6月22日現在
(A) 資 産	1,208,085,091円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	75,289,143
投資信託受益証券(評価額)	1,076,109,655
未 収 入 金	8,388,730
未 収 配 当 金	2,445,589
未 収 利 息	269
差 入 委 託 証 拠 金	45,851,705
(B) 負 債	7,089,280
未 払 金	7,089,280
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	1,200,995,811
元 本	826,739,972
次 期 繰 越 損 益 金	374,255,839
(D) 受 益 権 総 口 数	826,739,972口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,527円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2025年7月31日 至 2026年6月22日
(A) 配 当 等 収 益	10,451,103円
受 取 配 当 金	8,758,631
受 取 利 息	1,160,880
そ の 他 収 益 金	531,592
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	258,819,064
売 買 益	258,910,668
売 買 損	△91,604
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	17,503,745
取 引 益	22,389,842
取 引 損	△4,886,097
(D) そ の 他 費 用	△406,126
(E) 当 期 損 益 金 (A+B+C+D)	286,367,786
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	177,012,156
(G) 解 約 差 損 益 金	△89,124,103
(H) 計 (E+F+G)	374,255,839
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	374,255,839

(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199,920,858円、期中追加設定元本額は943,828,088円、期中一部解約元本額は317,008,974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。

My SMT ラッセル2000米国中小型株式インデックス(ノーロード)	821,131,144円
My SMT ラッセル3000全米株式インデックス(ノーロード)	5,608,828円

お知らせ

「一般社団法人投資信託協会」を、「一般社団法人資産運用業協会」に変更するため、投資信託約款に
所要の変更を行いました。

(変更日:2026年4月1日)