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	
信託期間	信託期間は2025年12月16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 日本株式モメンタムファンド	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。
	日本株式モメンタムマザーファンド	わが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	SMT 日本株式モメンタムファンド	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。 デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定します。
	日本株式モメンタムマザーファンド	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。 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。	

SMT 日本株式モメンタムファンド
（愛称:トレンドランキング・日本株）

運用報告書（全体版）

第1期（決算日　2026年9月17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。）

<510248>

【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。
・－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			株式組入比率	株式先物比率	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				
	円	円	%	%	%	%	百万円
設定日(2025年12月16日)	10,000	－	－	－	－	－	100
第1期(2026年 9月17日)	11,607	0	16.1	96.2	－	－	16,598

(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。

当期中の基準価額の推移

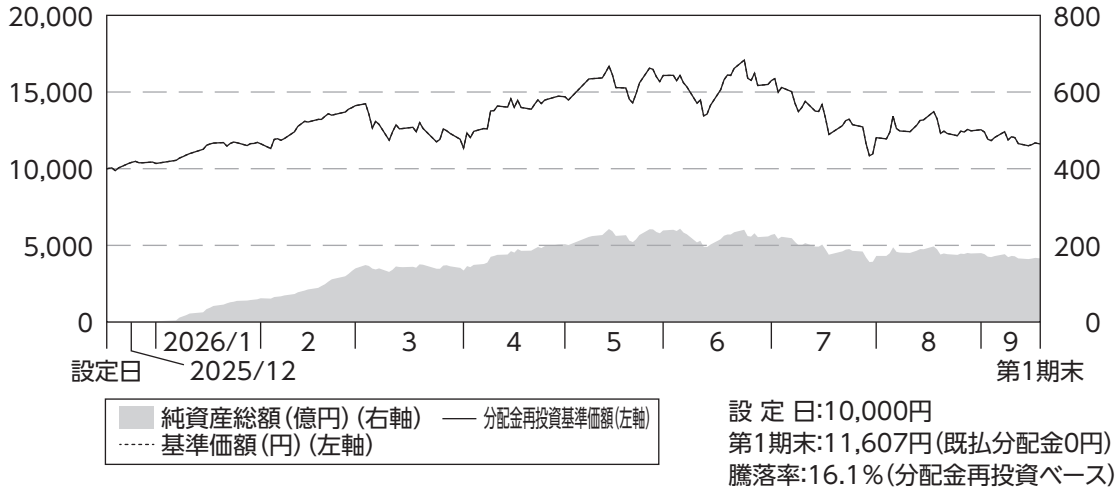
年月日	基準価額		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率			
(設定日)	円	%	%	%	%
2025年12月16日	10,000	－	－	－	－
12月末	10,338	3.4	96.0	－	－
2026年 1月末	11,629	16.3	98.7	－	－
2月末	14,116	41.2	99.3	－	－
3月末	11,336	13.4	96.2	－	－
4月末	14,690	46.9	97.1	－	－
5月末	16,086	60.9	97.1	－	－
6月末	15,748	57.5	96.1	－	－
7月末	12,023	20.2	98.1	－	－
8月末	12,542	25.4	98.3	－	－
(当期末)					
2026年 9月17日	11,607	16.1	96.2	－	－

(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。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



設 定 日:10,000円
第1期末:11,607円(既払分配金0円)
騰落率:16.1%(分配金再投資ベース)

(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は、2025年12月16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

当期の基準価額は上昇しました。
中東情勢の悪化などが懸念され下落する局面はあったものの、当ファンドではAI(人工知能)・半導体関連銘柄を中心に堅調に推移したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

日本株式市場は上昇しました。期初には衆議院選挙で自民党が大勝し、高市首相の積極財政による景気拡大への期待感から上昇しました。その後、中東情勢の緊迫化を受けたリスクオフにより一時大きく下落しましたが、米国のハイテク株高やAI・半導体関連分野への成長期待を受けて反発し、再び上昇基調となりました。期末にかけては、米ハイテク株の値動きが不安定となったことや利益確定売りが重石となり、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

「日本株式モメンタムマザーファンド」受益証券を高位に組み入れ運用しました。

【「日本株式モメンタムマザーファンド」の運用経過】
主として日本市場の株式の中から、株価のモメンタム性に着目し、「短期」・「中期」・「長期」それぞれの高モメンタム銘柄に投資することを基本戦略とし、中長期的な信託財産の成長を目指し運用を行いました。

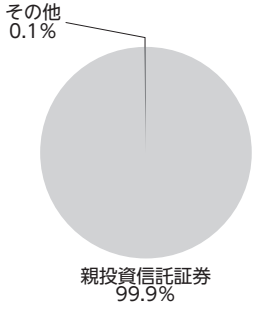
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

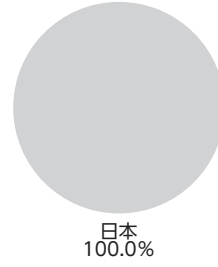
	当期末
	2026年9月17日
日本株式モメンタムマザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

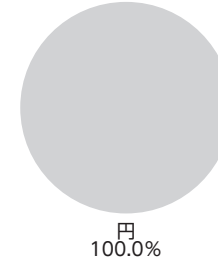
○資産別配分



○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

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

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した。
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12月16日～2026年9月17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）	1,607

（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

当ファンドは「日本株式モメンタムマザーファンド」受益証券への投資を通じて、株価のモメンタム性に着目し、「短期」・「中期」・「長期」それぞれの高モメンタム銘柄に投資を行います。
モメンタム戦略は、投資ファクターとして広く認知され、ファクターの有効性も高い傾向があります。当ファンドでは強いトレンドを持つ銘柄に集中投資しつつも、短・中・長期とホライゾンの異なる3種類のモメンタム戦略で銘柄を入れ替えることにより、特定銘柄への過度なリスク集中を避けることで、長期で安定したプラスのリターンを獲得することを目指します。
引き続き、上記の運用を行う方針です。

1万口当たりの費用明細

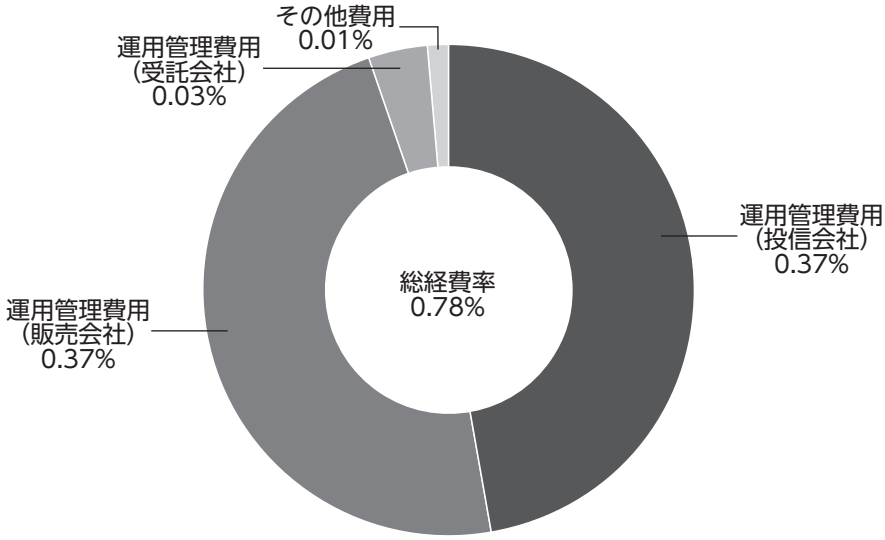
項目	当期 (2025年12月16日～2026年9月17日) 金額	当期 (2025年12月16日～2026年9月17日) 比率	項目の概要
(a)信託報酬	**77円**	**0.582%**	(a)信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,167円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。
(投信会社)	(37)	(0.279)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
(販売会社)	(37)	(0.279)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.025)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b)売買委託手数料	**35**	**0.263**	(b)売買委託手数料＝$\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕}$×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)	(35)	(0.263)	
(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)	(－)	(－)	
(c)有価証券取引税	**－**	**－**	(c)有価証券取引税＝$\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕}$×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**	**0.004**	(d)その他費用＝$\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕}$×10,000
(保管費用)	(－)	(－)	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)	(1)	(0.004)	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)	(－)	(－)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	**113**	**0.849**	

(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0.78%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
日本株式モメンタムマザーファンド	16,513,942	22,878,184	3,165,747	4,660,047

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
〈日本株式モメンタムマザーファンド〉

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	69,123,029千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	14,691,933千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	4.70

(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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
コール・ローン	53,859	4,434	8.2	53,725	4,424	8.2

(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。

〈日本株式モメンタムマザーファンド〉

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	%
コール・ローン	116,144	9,581	8.2	115,612	9,542	8.3

〈平均保有割合　100.0%〉
(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

自社による当ファンドの設定・解約状況

当期首残高（元本）	当期設定元本	当期解約元本	当期末残高（元本）	取引の理由
千円	千円	千円	千円	
－	100,000	100,000	－	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
日本株式モメンタムマザーファンド	13,348,195	16,590,472

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、13,348,195千口です。

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
日本株式モメンタムマザーファンド	16,590,472	99.2
コール・ローン等、その他	134,220	0.8
投資信託財産総額	16,724,692	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 2026年9月17日現在
(A) 資産	16,724,692,857円
コール・ローン等	134,217,071
日本株式モメンタムマザーファンド(評価額)	16,590,472,252
未収利息	3,534
(B) 負債	125,868,280
未払解約金	87,709,836
未払信託報酬	37,887,848
その他未払費用	270,596
(C) 純資産総額(A-B)	16,598,824,577
元本	14,300,650,129
次期繰越損益金	2,298,174,448
(D) 受益権総口数	14,300,650,129口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,607円

■損益の状況

項目	当期 自 2025年12月16日 至 2026年 9月17日
(A) 配当等収益	1,272,528円
受取利息	1,272,528
(B) 有価証券売買損益	△2,729,828,476
売買益	517,328,463
売買損	△3,247,156,939
(C) 信託報酬等	△87,962,784
(D) 当期損益金(A+B+C)	△2,816,518,732
(E) 追加信託差損益金	5,114,693,180
(配当等相当額)	(426,999)
(売買損益相当額)	(5,114,266,181)
(F) 計(D+E)	2,298,174,448
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	2,298,174,448
追加信託差損益金	5,114,693,180
(配当等相当額)	(44,466,540)
(売買損益相当額)	(5,070,226,640)
分配準備積立金	29,227,214
繰越損益金	△2,845,745,946

(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100,000,000円、期中追加設定元本額は28,326,936,589円、期中一部解約元本額は14,126,286,460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)	29,227,214円
(B)有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C)収益調整金額	2,268,947,234円
(D)分配準備積立金額	－円
(E)分配対象収益額(A+B+C+D)	2,298,174,448円
(F)期末残存口数	14,300,650,129口
(G)収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	1,607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)

日本株式モメンタムマザーファンド

運 用 報 告 書

第1期（決算日　2026年9月17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12月16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は行いません。 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

【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。
・－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		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率				
	円	%	%	%	%	百万円
設定日(2025年12月16日)	10,000	－	－	－	－	99
第1期(2026年 9月17日)	12,429	24.3	96.3	－	－	16,589

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」です。

当期中の基準価額の推移

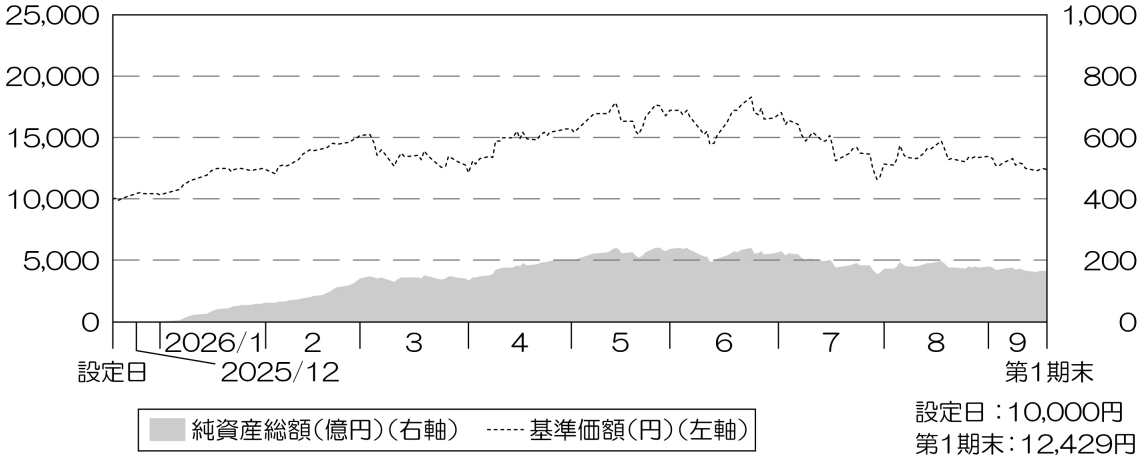
年月日	基準価額		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率			
(設定日)	円	%	%	%	%
2025年12月16日	10,000	－	－	－	－
12月末	10,337	3.4	96.0	－	－
2026年 1月末	12,384	23.8	98.7	－	－
2月末	15,139	51.4	99.3	－	－
3月末	12,079	20.8	96.2	－	－
4月末	15,664	56.6	97.2	－	－
5月末	17,194	71.9	97.1	－	－
6月末	16,863	68.6	96.1	－	－
7月末	12,861	28.6	98.0	－	－
8月末	13,426	34.3	98.3	－	－
(当期末)					
2026年 9月17日	12,429	24.3	96.3	－	－

(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。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



設定日：10,000円
第1期末：12,429円
騰落率：24.3%

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は上昇しました。
中東情勢の悪化などが懸念され下落する局面はあったものの、当ファンドではAI(人工知能)・半導体関連銘柄を中心に堅調に推移したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

日本株式市場は上昇しました。期初には衆議院選挙で自民党が大勝し、高市首相の積極財政による景気拡大への期待感から上昇しました。その後、中東情勢の緊迫化を受けたリスクオフにより一時大きく下落しましたが、米国のハイテク株高やAI・半導体関連分野への成長期待を受けて反発し、再び上昇基調となりました。期末にかけては、米ハイテク株の値動きが不安定となったことや利益確定売りが重石となり、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

主として日本市場の株式の中から、株価のモメンタム性に着目し、「短期」・「中期」・「長期」それぞれの高モメンタム銘柄に投資することを基本戦略とし、中長期的な信託財産の成長を目指し運用を行いました。

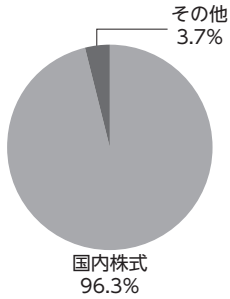
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

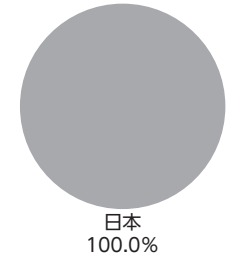
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	あいちフィナンシャルグループ	日本	5.1%
2	シンフォニアテクノロジー	日本	5.1%
3	三井Ｅ＆Ｓ	日本	5.1%
4	ほくほくフィナンシャルグループ	日本	4.9%
5	リクルートホールディングス	日本	4.8%
6	古河電気工業	日本	4.8%
7	太陽誘電	日本	4.8%
8	キオクシアホールディングス	日本	4.8%
9	マネーフォワード	日本	4.7%
10	KOKUSAI ELECTRIC	日本	4.7%
組入銘柄数		22	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

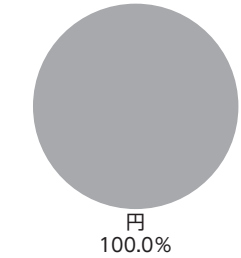
○資産別配分



○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

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

今後の運用方針

当ファンドは、株価のモメンタム性に着目し、「短期」・「中期」・「長期」それぞれの高モメンタム銘柄に投資を行います。
モメンタム戦略は、投資ファクターとして広く認知され、ファクターの有効性も高い傾向があります。当ファンドでは強いトレンドを持つ銘柄に集中投資しつつも、短・中・長期とホライゾンの異なる3種類のモメンタム戦略で銘柄を入れ替えることにより、特定銘柄への過度なリスク集中を避けることで、長期で安定したプラスのリターンを獲得することを目指します。
引き続き、上記の運用を行う方針です。

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2025年12月16日～2026年9月17日)		項目の概要
	金額	比率	
(a)売買委託手数料	**37円**	**0.264%**	(a)売買委託手数料＝〔期中の売買委託手数料〕／〔期中の平均受益権口数〕×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)	(37)	(0.264)	
(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)	(－)	(－)	
(b)有価証券取引税	**－**	**－**	(b)有価証券取引税＝〔期中の有価証券取引税〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(c)その他費用	**－**	**－**	(c)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(－)	(－)	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)	(－)	(－)	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)	(－)	(－)	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**	**0.264**	

(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(13,994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
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	6,444 (845)	43,419,887 (－)	4,673	25,703,141

(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。

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	69,123,029千円
(b)期中の平均組入株式時価総額	14,691,933千円
(c)売買高比率 (a)/(b)	4.70

(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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
コール・ローン	116,144	9,581	8.2	115,612	9,542	8.3

(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	当期末	
	株数	評価額
	千株	千円
化学(4.3%)		
レゾナック・ホールディングス	50.7	687,492
ガラス・土石製品(4.6%)		
日東紡績	256.4	737,406
非鉄金属(18.0%)		
三井金属	28.2	598,827
古河電気工業	210.8	793,240
フジクラ	153.6	747,571
ＳＷＣＣ	56.9	735,148
金属製品(4.4%)		
ＳＵＭＣＯ	244.9	702,250
機械(5.3%)		
三井Ｅ＆Ｓ	191.4	842,351
電気機器(34.0%)		
キオクシアホールディングス	15.8	788,104
イビデン	39.1	722,372
シンフォニアテクノロジー	67.6	847,028
KOKUSAI ELECTRIC	94.4	782,009
パナソニック ホールディングス	182	775,684
アドバンテスト	24.3	734,832
太陽誘電	87.6	788,400
精密機器(4.3%)		
セイコーグループ	70.7	683,669
情報・通信業(4.9%)		
マネーフォワード	129.2	782,952
銀行業(10.4%)		
あいちフィナンシャルグループ	429.6	853,185
ほくほくフィナンシャルグループ	97.3	811,092
サービス業(9.8%)		
カカクコム	84.7	321,436
リクルートホールディングス	46	802,470
ベイカレント	55.5	435,120
合計 株数・金額	2,616	15,972,643
合計 銘柄数〈比率〉	22	〈96.3%〉

(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。

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	15,972,643	93.9
コール・ローン等、その他	1,044,997	6.1
投資信託財産総額	17,017,640	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 2026年9月17日現在
(A) 資産	17,017,640,656円
コール・ローン等	532,489,259
株式(評価額)	15,972,643,150
未収入金	512,494,223
未収利息	14,024
(B) 負債	427,688,188
未払金	427,688,188
(C) 純資産総額(A-B)	16,589,952,468
元本	13,348,195,553
次期繰越損益金	3,241,756,915
(D) 受益権総口数	13,348,195,553口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,429円

■損益の状況

項目	当期 自 2025年12月16日 至 2026年 9月17日
(A) 配当等収益	115,917,470円
受取配当金	112,144,550
受取利息	3,772,914
その他収益金	6
(B) 有価証券売買損益	△1,744,102,505
売買益	4,463,860,051
売買損	△6,207,962,556
(C) 当期損益金(A+B)	△1,628,185,035
(D) 追加信託差損益金	6,364,242,377
(E) 解約差損益金	△1,494,300,427
(F) 計 (C+D+E)	3,241,756,915
次期繰越損益金(F)	3,241,756,915

(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) (D)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) (E)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99,950,000円、期中追加設定元本額は16,413,992,600円、期中一部解約元本額は3,165,747,047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 日本株式モメンタムファンド　13,348,195,553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)