

SMT 日本株配当貴族インデックス・オープン

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2016年8月30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 日本株配当貴族インデックス・オープン | 下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | 日本株配当貴族インデックスマザーファンド | わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | SMT 日本株配当貴族インデックス・オープン | 株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。 |
| | 日本株配当貴族インデックスマザーファンド | 株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。 |
| 分配方針 | 年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 | |

運用報告書(全体版)

第1期(決算日 2016年11月10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。

お問い合わせ先

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。)

PCサイト <http://www.smtam.jp/>

モバイルサイト <http://m.smtam.jp/>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-8574 東京都港区芝三丁目33番1号

「SMT 日本株配当貴族インデックス・オープン」の主要投資対象である「日本株配当貴族インデックスマザーファンド」は第1期決算日(2017年5月10日)を迎えていないため、記載すべき運用報告書はございません。

【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 | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額 |
|------------------|-------------|-----------|-----------|-----------|--------|--------|--------|------------|
| | (分配) | 税込 分配金 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | 騰落率 | | | |
| 設定日(2016年8月30日) | 円 10,000 | 円 — | % — | 10,000 | % — | % — | % — | 百万円 100 |
| 第1期(2016年11月10日) | 10,493 | 0 | 4.9 | 10,530 | 5.3 | 97.6 | 2.4 | 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」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 | | |
| (設定日) 2016年8月30日 | 円 10,000 | % — | 10,000 | % — | % — | % — |
| 8月末 | 10,075 | 0.8 | 10,081 | 0.8 | 97.3 | 2.5 |
| 9月末 | 10,105 | 1.1 | 10,110 | 1.1 | 97.5 | 2.4 |
| 10月末 | 10,640 | 6.4 | 10,663 | 6.6 | 97.5 | 2.4 |
| (当期末) 2016年11月10日 | 10,493 | 4.9 | 10,530 | 5.3 | 97.6 | 2.4 |

(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」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、S&P/JPX配当貴族指数(配当込み)です。

S&P/JPX配当貴族指数(以下「当インデックス」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)、株式会社日本取引所グループ(以下「JPX」)および株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が公表する指数で、TOPIXの構成銘柄のうち、10年以上にわたり毎年増配しているか、または安定した配当を維持している銘柄を対象とし^{*}、配当利回りにより加重され算出されます。

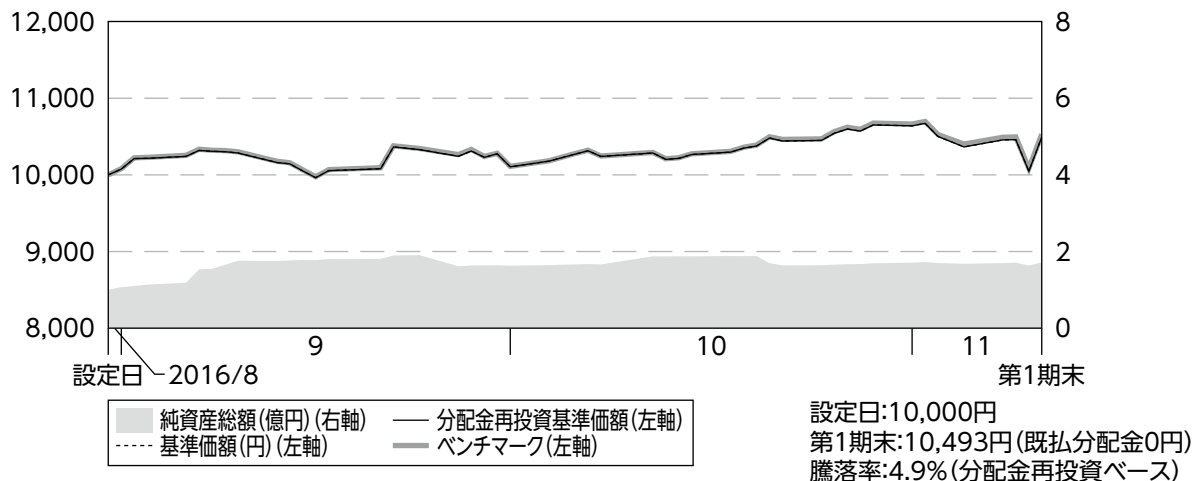
※リバランス時における構成銘柄数は最低40銘柄であり、10年以上にわたり毎年増配しているか、または安定した配当を維持している銘柄数が40銘柄を下回った場合には、以下の対応が行われます。

- ・7年以上にわたり毎年増配しているか、または安定した配当を維持している銘柄を配当利回りの高いものから順に40銘柄になるまで構成銘柄に追加します。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。当インデックスはSPDJ、JPXおよび東証の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。JPX[®]はJPXの登録商標であり、これを利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社に付与されています。TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、東証の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pもしくはそれぞれの関連会社、JPXまたは東証によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいづれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

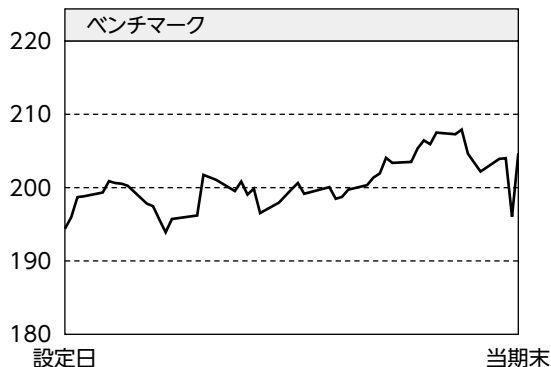


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2016年8月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるS&P/JPX配当貴族指数(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、設定日比では上昇しました。

投資環境



当期前半は、米国の利上げ観測の後退による円高進行が嫌気されたことや、ドイツ大手銀行の財務懸念が浮上する一方、日銀によるETF買いが下支えとなり、国内株式市場はもみ合い推移となりました。その後、米国の年内利上げ観測が強まり円高進行が一服したことが好感されて、10月にかけて国内株式市場は堅調に推移しました。

期末は、米国大統領選挙の想定外の結果を受け、国内株式市場は乱高下する展開となりました。

当ファンドのポートフォリオ

株式への投資は「日本株配当貴族インデックスマザーファンド」受益証券の組み入れにより行いました。

【「日本株配当貴族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S&P/JPX配当貴族指数(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

- (1) 株式組入比率を高位に維持するため、現物株式に加え適宜TOPIX先物取引を利用し、効率的な運用に努めました。
- (2) 現物株式については、S&P/JPX配当貴族指数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。

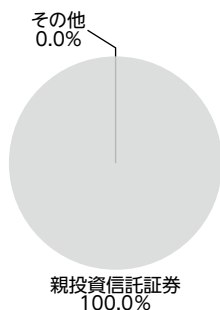
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

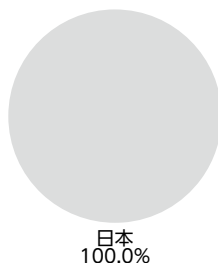
| | 当期末 |
|----------------------|-------------|
| | 2016年11月10日 |
| 日本株配当貴族インデックスマザーファンド | 100.0% |
| その他 | 0.0% |
| 組入ファンド数 | 1 |

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

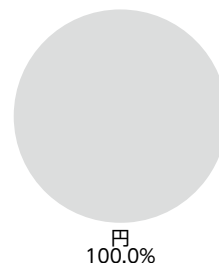
○資産別配分



○国別配分



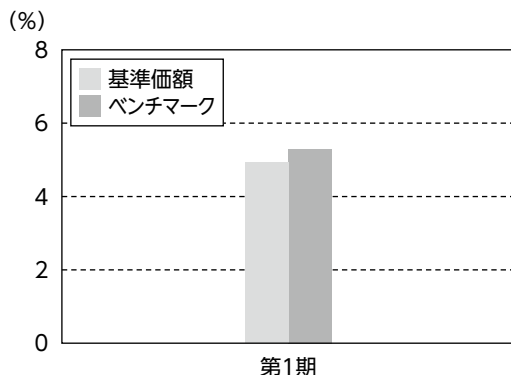
○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

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、設定解約要因や信託報酬要因などです。

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 | |
|-----------|------------------------|-----|
| | 2016年8月30日~2016年11月10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) | 492 |

(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

日本株配当貴族インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、S&P/JPX配当貴族指数(配当込み)に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|------------------|--------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | (2016年8月30日~2016年11月10日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 9円 | 0.091% | (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10,273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) | (0.041) | |
| (販売会社) | (4) | (0.039) | |
| (受託会社) | (1) | (0.011) | |
| (b) 売買委託手数料 | 2 | 0.020 | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株式) | (2) | (0.019) | |
| (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)) | (-) | (-) | |
| (投資信託証券) | (-) | (-) | |
| (商品) | (-) | (-) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| (c) 有価証券取引税 | - | - | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (-) | (-) | |
| (新株予約権証券) | (-) | (-) | |
| (オプション証券等) | (-) | (-) | |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (-) | (-) | |
| (公社債) | (-) | (-) | |
| (投資信託証券) | (-) | (-) | |
| (d) その他費用 | 0 | 0.001 | (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、金銭信託預入に係る手数料等 |
| (保管費用) | (-) | (-) | |
| (監査費用) | (0) | (0.001) | |
| (その他) | (0) | (0.000) | |
| 合計 | 11 | 0.112 | |

(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。

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 |
| 日本株配当貴族インデックス マザーファンド | 千口 217,823 | 千円 220,723 | 千口 54,619 | 千円 56,601 |

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>

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------------|----------------------|
| | 日本株配当貴族インデックスマザーファンド |
| (a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 282,731千円 |
| (b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 143,259千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b) | 1.97 |

(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 |
| 金 銭 信 託 | 百万円 0.726875 | 百万円 0.726875 | % 100.0 | 百万円 0.712396 | 百万円 0.712396 | % 100.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 44 | 9 | 20.5 | 44 | 9 | 20.5 |

(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。

< 日本株配当貴族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 |
| 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 | 874 | 200 | 22.9 | 871 | 199 | 22.8 |

< 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。

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 - | 千円 500 | 千円 - | 千円 500 | 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 末 | |
|----------------------|---------------|---------------|
| | 口 数 | 評 価 額 |
| 日本株配当貴族インデックスマザーファンド | 千口 163,203 | 千円 171,396 |

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、163,203千口です。

※ 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 |
| 日本株配当貴族インデックスマザーファンド | 千円 171,396 | % 99.3 |
| コール・ローン等、その他 | 1,196 | 0.7 |
| 投資信託財産総額 | 172,592 | 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 2016年11月10日現在 |
|-------------------------------|------------------------|
| (A)資 産 | 172,592,360円 |
| コール・ローン等 | 483,234 |
| 日本株配当貴族インデックス マザーファンド(評価額) | 171,396,778 |
| 未 収 入 金 | 712,348 |
| (B)負 債 | 1,187,041 |
| 未 払 解 約 金 | 1,035,852 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 149,434 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 1,755 |
| (C)純 資 産 総 額(A-B) | 171,405,319 |
| 元 本 | 163,358,942 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 8,046,377 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | 163,358,942口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,493円 |

■損益の状況

| 項 目 | 当 期 自 2016年 8月30日 至 2016年11月10日 |
|---------------------|---------------------------------------|
| (A)配 当 等 収 益 | △92円 |
| 支 払 利 息 | △92 |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | 5,770,571 |
| 売 買 益 | 7,195,393 |
| 売 買 損 | △1,424,822 |
| (C)信 託 報 酬 等 | △151,190 |
| (D)当 期 損 益 金(A+B+C) | 5,619,289 |
| (E)追 加 信 託 差 損 益 金 | 2,427,088 |
| (配 当 等 相 当 額) | (△19) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (2,427,107) |
| (F) 計 (D+E) | 8,046,377 |
| (G)収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(F+G) | 8,046,377 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 2,427,088 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,157,774) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (1,269,314) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 5,619,289 |

- (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100,500,000円、期中追加設定元本額は131,165,016円、期中一部解約元本額は68,306,074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) | | 1,960,040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) | | 3,659,249円 |
| (C) | 収益調整金額 | | 2,427,088円 |
| (D) | 分配準備積立金額 | | －円 |
| (E) | 分配対象収益額(A+B+C+D) | | 8,046,377円 |
| (F) | 期末残存口数 | | 163,358,942口 |
| (G) | 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000) | | 492円 |
| (H) | 分配金額(1万口当たり) | | －円 |
| (I) | 収益分配金金額(F×H/10,000) | | －円 |

お知らせ

該当事項はありません。