

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2010年7月30日から無期限です。	
運用方針	主として、「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、日経平均株価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	SMT 日経225 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	SMT 日経225 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。	

SMT 日経225インデックス・オープン

運用報告書(全体版)

第21期(決算日 2020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。

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。
- ・ ー印は、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	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円
第17期(2018年11月12日)	26,391	0	△0.3	22,269.88	△1.0	98.3	1.6	25,074
第18期(2019年5月10日)	25,538	0	△3.2	21,344.92	△4.2	97.5	2.4	25,452
第19期(2019年11月11日)	28,136	0	10.2	23,331.84	9.3	97.1	2.8	21,620
第20期(2020年5月11日)	24,845	0	△11.7	20,390.66	△12.6	95.6	3.0	25,529
第21期(2020年11月10日)	30,509	0	22.8	24,905.59	22.1	95.1	2.8	19,973

(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		
(当期首) 2020年5月11日	円 24,845	% —	円 20,390.66	% —	% 95.6	% 3.0
5月末	26,641	7.2	21,877.89	7.3	97.6	2.2
6月末	27,167	9.3	22,288.14	9.3	96.9	3.1
7月末	26,455	6.5	21,710.00	6.5	97.7	2.3
8月末	28,194	13.5	23,139.76	13.5	96.3	3.4
9月末	28,409	14.3	23,185.12	13.7	96.3	3.7
10月末	28,144	13.3	22,977.13	12.7	96.0	3.9
(当期末) 2020年11月10日	30,509	22.8	24,905.59	22.1	95.1	2.8

(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。

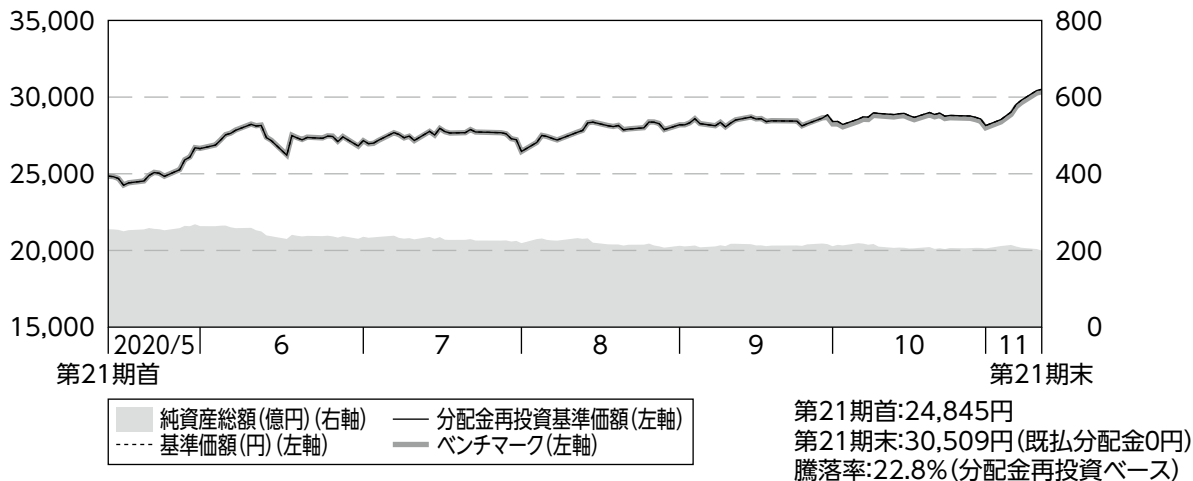
(注3) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、日経平均株価(日経225)です。

日経平均株価(日経225)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、東京証券取引所市場第一部上場銘柄のうち代表的な225銘柄を対象として算出される株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は当ファンドを保証するものではなく、当ファンドについて一切の責任を負いません。

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、2020年5月11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株価(日経225)の動きを反映して基準価額は変動し、当期末の基準価額は前期末に比べて大幅に上昇しました。

投資環境



当期の国内株式市場は大幅に上昇しました。国内の緊急事態宣言が全面解除となったことや、世界的な経済活動再開への期待などから国内株式市場は期初から6月上旬にかけて上昇しました。その後は、内外の新型コロナウイルス新規感染者数の増加や米大統領選挙への思惑などが重石となる一方、米中景気指標の好転や堅調な米国株式市場が相場を下支えし、緩やかな上昇傾向が続きました。期末にかけては、米大統領選挙結果や新型コロナウイルスワクチンの早期実用化期待などから世界的な株高となり、国内株式市場も大幅に上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、運用の基本方針に従い、主要投資対象である「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株価(日経225)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

期を通じて株式組入比率は100%に近い水準を維持しました。なお、資金の効率的な運用を行う目的で、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、日経平均株価(日経225)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。

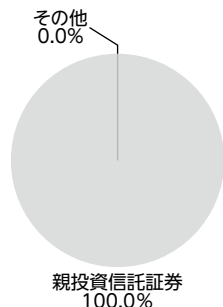
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

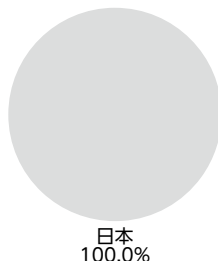
	当期末
	2020年11月10日
日経225インデックス マザーファンド(S)	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

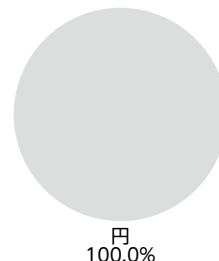
○資産別配分



○国別配分



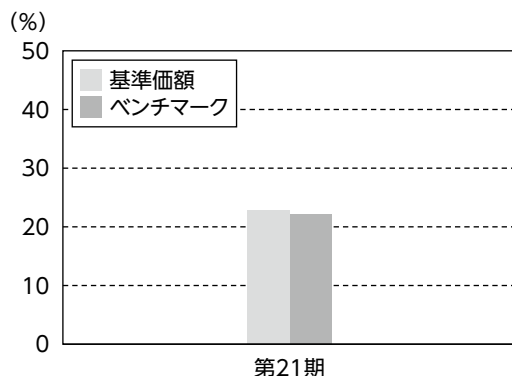
○通貨別配分



(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。

差異の主な要因は配当金要因※(プラス)および信託報酬要因(マイナス)によるものです。

※ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる差異要因です。

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21期	
	2020年5月12日~2020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)	20,508

(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

主として、「日経225インデックス マザーファンド(S)」の受益証券に投資し、日経平均株価と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		項目の概要
	(2020年5月12日~2020年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	56円	0.204%	(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27,501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)	(21)	(0.077)	
(販売会社)	(27)	(0.099)	
(受託会社)	(8)	(0.028)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(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)	(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	1	0.003	(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)	(1)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	57	0.208	

(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。

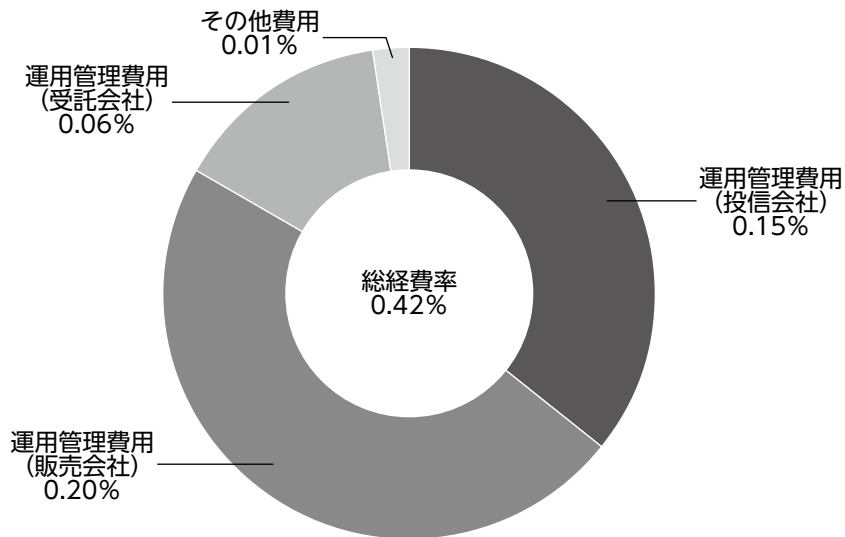
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.42%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
日経225インデックス マザーファンド(S)	3,779,050	6,445,019	9,846,433	17,062,678

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

<日経225インデックス マザーファンド(S)>

項 目	当 期
(a) 当期中の株式売買金額	45,493,200千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	71,199,914千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.63

(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 34	百万円 34	% 100.0	百万円 34	百万円 34	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	16,694	1,754	10.5	16,641	1,781	10.7

(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。

<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 310	百万円 310	% 100.0	百万円 310	百万円 310	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	312,692	30,974	9.9	313,231	31,428	10.0

<平均保有割合 30.3%>

(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	3百万円	17百万円	29百万円

(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。

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
日経225インデックス マザーファンド(S)	千口 16,656,753	千口 10,589,371	千円 19,963,082

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、36,204,893千口です。

※ 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 19,963,082	% 93.5
コール・ローン等、その他	1,382,472	6.5
投資信託財産総額	21,345,554	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 2020年11月10日現在
(A)資 産	21,345,554,119円
コール・ローン等	167,475,069
日経225インデックス マザーファンド(S)(評価額)	19,963,082,243
未 収 入 金	1,214,996,807
(B)負 債	1,372,512,066
未 払 解 約 金	1,325,735,006
未 払 信 託 報 酬	46,153,195
未 払 利 息	237
そ の 他 未 払 費 用	623,628
(C)純 資 産 総 額(A-B)	19,973,042,053
元 本	6,546,689,795
次 期 繰 越 損 益 金	13,426,352,258
(D)受 益 権 総 口 数	6,546,689,795口
1万口当たり基準価額(C/D)	30,509円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年 5月12日 至 2020年11月10日
(A)配 当 等 収 益	△19,820円
受 取 利 息	166
支 払 利 息	△19,986
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	2,904,134,358
売 買 益	4,488,966,074
売 買 損	△1,584,831,716
(C)信 託 報 酬 等	△46,777,135
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	2,857,337,403
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△270,057,233
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	10,839,072,088
(配 当 等 相 当 額)	(9,015,049,534)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,824,022,554)
(G) 計 (D+E+F)	13,426,352,258
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	13,426,352,258
追 加 信 託 差 損 益 金	10,839,072,088
(配 当 等 相 当 額)	(9,033,034,600)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,806,037,488)
分 配 準 備 積 立 金	2,587,280,170

- (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10,275,319,292円、期中追加設定元本額は4,590,110,113円、期中一部解約元本額は8,318,739,610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)		130,482,487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)		2,100,451,361円
(C)	収益調整金額		10,839,072,088円
(D)	分配準備積立金額		356,346,322円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		13,426,352,258円
(F)	期末残存口数		6,546,689,795口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		20,508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。

日経225インデックス マザーファンド(S)

運用報告書

第13期（決算日 2020年5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、日経平均株価（日経225）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 株式先物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第9期(2016年5月20日)	11,592	△15.6	16,736.35	△17.1	97.3	78,066
第10期(2017年5月22日)	13,894	19.9	19,678.28	17.6	95.5	34,674
第11期(2018年5月21日)	16,551	19.1	23,002.37	16.9	97.0	117,608
第12期(2019年5月20日)	15,653	△5.4	21,301.73	△7.4	96.7	114,055
第13期(2020年5月20日)	15,466	△1.2	20,595.15	△3.3	95.5	80,224

(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 株式先物率
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2019年5月20日	15,653	－	21,301.73	－	96.7
5月末	15,137	△3.3	20,601.19	△3.3	96.5
6月末	15,658	0.0	21,275.92	△0.1	97.7
7月末	15,840	1.2	21,521.53	1.0	97.4
8月末	15,251	△2.6	20,704.37	△2.8	96.6
9月末	16,143	3.1	21,755.84	2.1	96.6
10月末	17,013	8.7	22,927.04	7.6	97.8
11月末	17,287	10.4	23,293.91	9.4	97.2
12月末	17,587	12.4	23,656.62	11.1	95.9
2020年1月末	17,248	10.2	23,205.18	8.9	95.8
2月末	15,729	0.5	21,142.96	△0.7	91.7
3月末	14,211	△9.2	18,917.01	△11.2	94.1
4月末	15,166	△3.1	20,193.69	△5.2	95.7
(当期末) 2020年5月20日	15,466	△1.2	20,595.15	△3.3	95.5

(注1) 騰落率は期首比です。

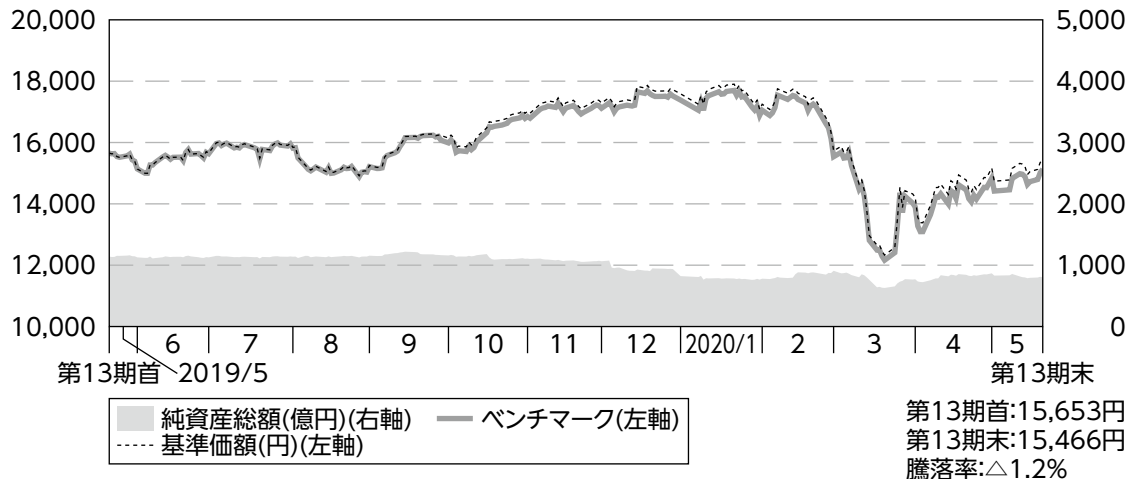
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、日経平均株価(日経225)です。

日経平均株価(日経225)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、東京証券取引所市場第一部上場銘柄のうち代表的な225銘柄を対象として算出される株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は当ファンドを保証するものではなく、当ファンドについて一切の責任を負いません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

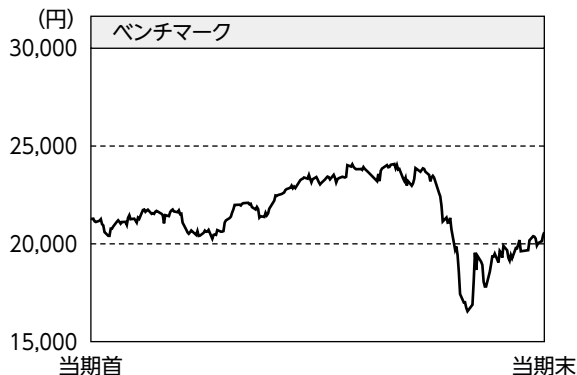


(注)ベンチマークは、2019年5月20日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークである日経平均株価(日経225)の動きを反映して基準価額は変動し、期末では期首に比べて下落しました。

投資環境



当期の国内株式市場は下落しました。

期初から年末までは、米中通商協議の進展や企業業績の改善期待などから、国内株式市場は上昇しました。年明け以降は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受け、経済活動の停滞による企業業績への影響が懸念されたこと、原油価格が急落したことなどから3月中旬にかけて大きく下落しました。その後は、各国の金融緩和政策や大規模な経済対策が打ち出されたこと、欧米での経済活動再開の動きなどが好感され、国内株式市場はやや値を戻しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークである日経平均株価(日経225)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

期を通じて株式組入比率は100%に近い水準を維持しました。なお、資金の効率的な運用を行う目的で、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、日経平均株価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

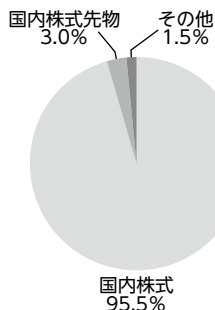
○上位10銘柄

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	8.8%
2	ソフトバンクグループ	日本	4.5%
3	東京エレクトロン	日本	3.7%
4	KDDI	日本	3.2%
5	ファナック	日本	3.0%
6	日経平均株価指数先物 2006	日本	3.0%

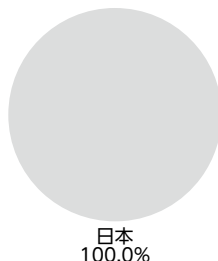
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	テルモ	日本	2.6%
8	ダイキン工業	日本	2.5%
9	中外製薬	日本	2.3%
10	信越化学工業	日本	2.0%
組入銘柄数		226	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

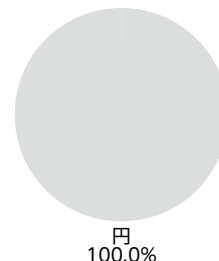
○資産別配分



○国別配分



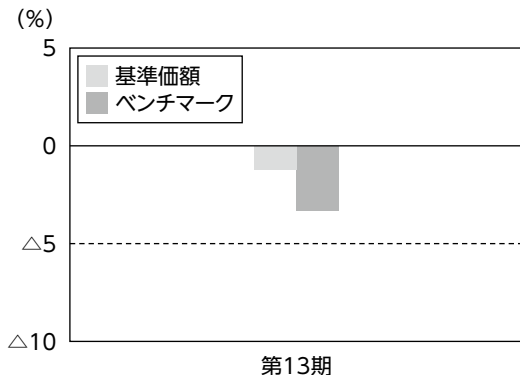
○通貨別配分



(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。
 (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3.0%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。

差異の主な要因は配当金要因*によるものです。

*ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる差異要因です。

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、日経平均株価(日経225)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		項目の概要
	(2019年5月21日~2020年5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)	0円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.002% (0.001) (-) (-) (-) (-) (-) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(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)	0.000 (-) (-) (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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.002	

(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(16,022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 15,664 (597)	千円 51,829,530 (-)	千株 25,347	千円 85,279,888

(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 81,266	百万円 81,101	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	137, 109, 419千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	96, 432, 709千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	1. 42

(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 196	百万円 196	% 100.0	百万円 196	百万円 196	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	838, 429	138, 718	16. 5	840, 216	139, 066	16. 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。

■利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	30百万円	53百万円	39百万円

(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)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(0.1%)			
日本水産	190	134	64,990
マルハニチロ	19	13.4	30,096
鉱業(0.1%)			
国際石油開発帝石	76	53.6	39,728
建設業(2.1%)			
コムシスホールディングス	190	134	410,710
大成建設	38	26.8	100,634
大林組	190	134	128,908
清水建設	190	134	117,384
長谷工コーポレーション	38	26.8	33,553
鹿島建設	95	67	80,802
大和ハウス工業	190	134	348,936
積水ハウス	190	134	260,295
日揮ホールディングス	190	134	141,504
千代田化工建設	190	—	—
食料品(4.0%)			
日清製粉グループ本社	190	134	221,234
明治ホールディングス	38	26.8	203,948
日本ハム	95	67	252,590
サッポロホールディングス	38	26.8	54,457
アサヒグループホールディングス	190	134	494,728
キリンホールディングス	190	134	278,050
宝ホールディングス	190	134	107,602
キッコーマン	190	134	692,780
味の素	190	134	261,166
ニチレイ	95	67	196,243
日本たばこ産業	190	134	272,757
繊維製品(0.2%)			
東洋紡	19	13.4	19,791
ユニチカ	19	13.4	4,515
帝人	38	26.8	45,318
東レ	190	134	66,531
パルプ・紙(0.1%)			
王子ホールディングス	190	134	75,442
日本製紙	19	13.4	20,770
化学(8.6%)			
クラレ	190	134	146,060
旭化成	190	134	104,386
昭和電工	19	13.4	30,793
住友化学	190	134	43,014
日産化学	190	134	605,680

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
東ソー	95	67	98,021
トクヤマ	38	26.8	64,025
デンカ	38	26.8	70,028
信越化学工業	190	134	1,642,170
三井化学	38	26.8	53,921
三菱ケミカルホールディングス	95	67	40,334
宇部興産	19	13.4	23,771
日本化薬	190	134	138,958
花王	190	134	1,175,314
D I C	19	13.4	35,925
富士フイルムホールディングス	190	134	661,424
資生堂	190	134	881,988
日東電工	190	134	727,620
医薬品(10.0%)			
協和キリン	190	134	356,976
武田薬品工業	190	134	552,750
アステラス製薬	950	670	1,149,720
大日本住友製薬	190	134	188,538
塩野義製薬	190	134	777,602
中外製薬	190	134	1,865,280
エーザイ	190	134	1,012,906
第一三共	190	134	1,148,514
大塚ホールディングス	190	134	583,302
石油・石炭製品(0.3%)			
出光興産	76	53.6	135,232
J X T Gホールディングス	190	134	53,466
ゴム製品(0.7%)			
横浜ゴム	95	67	100,500
ブリヂストン	190	134	450,374
ガラス・土石製品(1.1%)			
A G C	38	26.8	79,033
日本板硝子	19	13.4	5,132
日本電気硝子	57	40.2	66,370
住友大阪セメント	19	13.4	50,317
太平洋セメント	19	13.4	30,337
東海カーボン	190	134	120,332
T O T O	95	67	261,970
日本碍子	190	134	189,744
鉄鋼(0.1%)			
日本製鉄	19	13.4	12,495
神戸製鋼所	19	13.4	5,159
ジェイ エフ イー ホールディングス	19	13.4	9,835

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
大太平洋金属	19	13.4	21,547	
非鉄金属(0.8%)				
日本軽金属ホールディングス	190	134	23,048	
三井金属鉱業	19	13.4	28,582	
東邦亜鉛	19	13.4	18,518	
三菱マテリアル	19	13.4	31,744	
住友金属鉱山	95	67	193,998	
DOWAホールディングス	38	26.8	85,090	
古河電気工業	19	13.4	32,093	
住友電気工業	190	134	158,857	
フジクラ	190	134	44,488	
金属製品(0.2%)				
SUMCO	19	13.4	22,056	
東洋製鐵グループホールディングス	190	134	143,246	
機械(4.6%)				
日本製鋼所	38	26.8	37,010	
オークマ	38	26.8	115,642	
アマダ	190	134	129,846	
小松製作所	190	134	281,668	
住友重機械工業	38	26.8	63,248	
日立建機	190	134	351,214	
クボタ	190	134	192,290	
荏原製作所	38	26.8	64,293	
ダイキン工業	190	134	1,999,950	
日本精工	190	134	103,180	
NTN	190	134	28,006	
ジェイテクト	190	134	108,004	
日立造船	38	26.8	9,862	
三菱重工業	19	13.4	34,900	
IHI	19	13.4	18,063	
電気機器(19.6%)				
日清紡ホールディングス	190	134	99,294	
コニカミノルタ	190	134	51,724	
ミネベアミツミ	190	134	246,694	
日立製作所	38	26.8	87,394	
三菱電機	190	134	178,890	
富士電機	38	26.8	74,343	
安川電機	190	134	486,420	
オムロン	190	134	929,960	
ジェス・ユアサ コーポレーション	38	26.8	45,774	
日本電気	19	13.4	66,531	
富士通	19	13.4	139,092	
沖電気工業	19	13.4	14,271	
セイコーエプソン	380	268	311,148	
パナソニック	190	134	118,134	
ソニー	190	134	904,098	
TDK	190	134	1,255,580	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
アルプスアルパイン	190	134	158,656	
横河電機	190	134	194,702	
アドバンテスト	380	268	1,409,680	
カシオ計算機	190	134	222,574	
ファナック	190	134	2,438,130	
京セラ	380	268	1,539,392	
太陽誘電	190	134	398,248	
SCREENホールディングス	38	26.8	138,824	
キヤノン	285	201	443,506	
リコー	190	134	101,706	
東京エレクトロン	190	134	2,984,180	
輸送用機器(4.3%)				
デンソー	190	134	520,054	
三井E&Sホールディングス	19	13.4	7,061	
川崎重工業	19	13.4	21,600	
日産自動車	190	134	51,054	
いすゞ自動車	95	67	59,676	
トヨタ自動車	190	134	859,610	
日野自動車	190	134	86,430	
三菱自動車工業	19	13.4	3,939	
マツダ	38	26.8	16,857	
本田技研工業	380	268	689,832	
スズキ	190	134	464,310	
SUBARU	190	134	291,986	
ヤマハ発動機	190	134	186,796	
精密機器(4.1%)				
テルモ	760	536	2,089,328	
ニコン	190	134	129,444	
オリンパス	760	536	905,036	
シチズン時計	190	134	48,106	
その他製品(2.2%)				
バンダイナムコホールディングス	—	134	777,736	
凸版印刷	95	67	107,200	
大日本印刷	95	67	147,601	
ヤマハ	190	134	661,960	
電気・ガス業(0.2%)				
東京電力ホールディングス	19	13.4	4,730	
中部電力	19	13.4	19,356	
関西電力	19	13.4	13,728	
東京瓦斯	38	26.8	65,928	
大阪瓦斯	38	26.8	55,744	
陸運業(2.0%)				
東武鉄道	38	26.8	101,438	
東急	95	67	110,148	
小田急電鉄	95	67	170,917	
京王電鉄	38	26.8	167,232	
京成電鉄	95	67	228,135	

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
東日本旅客鉄道	19	13.4	108,406			
西日本旅客鉄道	19	13.4	86,322			
東海旅客鉄道	19	13.4	238,721			
日本通運	19	13.4	66,464			
ヤマトホールディングス	190	134	283,276			
海運業(0.1%)						
日本郵船	19	13.4	19,724			
商船三井	19	13.4	24,441			
川崎汽船	19	13.4	14,833			
空運業(0.0%)						
ANAホールディングス	19	13.4	31,503			
倉庫・運輸関連業(0.2%)						
三菱倉庫	95	67	167,567			
情報・通信業(11.1%)						
Zホールディングス	76	53.6	23,744			
トレンドマイクロ	190	134	770,500			
スカパーJ SATホールディングス	19	13.4	5,681			
日本電信電話	38	53.6	131,722			
KDDI	1,140	804	2,557,524			
NTTドコモ	19	13.4	40,937			
東宝	19	13.4	52,394			
エヌ・ティ・ティ・データ	950	670	797,970			
コナミホールディングス	190	134	466,990			
ソフトバンクグループ	570	804	3,649,356			
卸売業(1.8%)						
双日	19	13.4	3,202			
伊藤忠商事	190	134	300,830			
丸紅	190	134	64,695			
豊田通商	190	134	328,702			
三井物産	190	134	215,204			
住友商事	190	134	167,232			
三菱商事	190	134	322,136			
小売業(12.1%)						
J.フロント リテイリング	95	67	59,161			
三越伊勢丹ホールディングス	190	134	92,862			
セブン&アイ・ホールディングス	190	134	480,390			
ファミリーマート	760	536	990,528			
高島屋	95	67	66,464			
丸井グループ	190	134	234,634			
イオン	190	134	309,138			
ファーストリテイリング	190	134	7,055,100			
銀行業(0.6%)						
コンソルディア・フィナンシャルグループ	190	134	42,210			
新生銀行	19	13.4	17,795			
あおぞら銀行	19	13.4	24,897			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	190	134	56,682			
りそなホールディングス	19	13.4	4,706			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
三井住友トラスト・ホールディングス	19	13.4	39,496			
三井住友フィナンシャルグループ	19	13.4	38,866			
千葉銀行	190	134	62,042			
ふくおかフィナンシャルグループ	38	26.8	43,791			
静岡銀行	190	134	84,152			
みずほフィナンシャルグループ	190	134	16,468			
証券・商品先物取引業(0.3%)						
大和証券グループ本社	190	134	56,306			
野村ホールディングス	190	134	56,775			
松井証券	190	134	103,448			
保険業(0.8%)						
SOMPOホールディングス	47.5	33.5	110,717			
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	57	40.2	119,414			
ソニーフィナンシャルホールディングス	38	26.8	69,546			
第一生命ホールディングス	19	13.4	17,031			
東京海上ホールディングス	95	67	301,366			
T&Dホールディングス	38	26.8	23,074			
その他金融業(0.2%)						
クレディセゾン	190	134	154,770			
不動産業(1.3%)						
東急不動産ホールディングス	190	134	70,484			
三井不動産	190	134	258,821			
三菱地所	190	134	221,971			
東京建物	95	67	86,229			
住友不動産	190	134	389,136			
サービス業(6.1%)						
エムスリー	—	321.6	1,357,152			
ディー・エヌ・エー	57	40.2	58,129			
電通グループ	190	134	309,942			
サイバーエージェント	38	26.8	142,308			
楽天	190	134	132,660			
リクルートホールディングス	570	402	1,361,976			
日本郵政	190	134	101,062			
東京ドーム	95	—	—			
セコム	190	134	1,231,728			
合 計	株 数・金 額	33,145	24,059	76,610,674		
	銘柄数<比率>	225	225	<95.5%>		

(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 2 2 5	2,383	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 76,610,674	% 93.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,108,003	6.3
投 資 信 託 財 産 総 額	81,718,677	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 2020年5月20日現在
(A)資 産	81,789,854,672円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 株 式(評価額)	2,019,712,362 76,610,674,300
未 収 入 金	2,493,096,026
未 収 配 当 金	666,371,984
(B)負 債	1,565,655,554
前 受 金	71,177,220
未 払 解 約 金	1,494,473,946
未 払 利 息	4,388
(C)純 資 産 総 額(A-B)	80,224,199,118
元 本	51,869,956,896
次 期 繰 越 損 益 金	28,354,242,222
(D)受 益 権 総 口 数	51,869,956,896口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,466円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年5月21日 至 2020年5月20日
(A)配 当 等 収 益	1,979,589,309円
受 取 配 当 金	1,981,283,484
受 取 利 息	8,854
そ の 他 収 益 金	177,575
支 払 利 息	△1,880,604
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△176,084,082
売 買 益	10,911,314,301
売 買 損	△11,087,398,383
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△978,057,480
取 引 益	1,040,831,270
取 引 損	△2,018,888,750
(D)そ の 他 費 用	△1,706
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	825,446,041
(F)前 期 繰 越 損 益 金	41,191,734,006
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	31,784,186,463
(H)解 約 差 損 益 金	△45,447,124,288
(I)計 (E+F+G+H)	28,354,242,222
次 期 繰 越 損 益 金(I)	28,354,242,222

(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72,863,478,360円、期中追加設定元本額は56,135,995,671円、期中一部解約元本額は77,129,517,135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。

日経225オープン(適格機関投資家専用)	20,958,786,163円
SMT 日経225 インデックス・オープン	16,563,661,197円
日経225オープン2(適格機関投資家専用)	10,010,710,772円
SMTAMバランスファンド2002(適格機関投資家専用)	2,363,471,312円
日経225オープン3(適格機関投資家専用)	1,870,417,150円
i-SMT 日経225インデックス(ノーロード)	102,910,302円

お知らせ

該当事項はありません。