

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1月8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	日経225インデックスe	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(M)	わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち日経平均株価(日経225)に採用されている銘柄(採用予定の銘柄を含みます。)を主要投資対象とします。
組入制限	日経225インデックスe	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(M)	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。	

日経225インデックスe

運用報告書(全体版)

第6期(決算日 2021年5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。)

【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		株式組入率	株式先比率	株式先比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
第2期(2017年5月15日)	円	円	%	円	%	%	%	%	百万円
	11,505	0	22.7	19,869.85	20.7	92.7	5.9	4.6	1,020
第3期(2018年5月15日)	13,431	0	16.7	22,818.02	14.8	95.2	4.6	11.9	1,327
第4期(2019年5月15日)	12,713	0	△5.3	21,188.56	△7.1	88.0	11.9	20.8	1,281
第5期(2020年5月15日)	12,263	0	△3.5	20,037.47	△5.4	79.1	20.8	16.3	1,186
第6期(2021年5月17日)	17,268	0	40.8	27,824.83	38.9	83.6	16.3		1,298

(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	株式先比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首)	円	%	円	%	%	%
2020年 5月15日	12,263	—	20,037.47	—	79.1	20.8
5月末	13,378	9.1	21,877.89	9.2	79.3	20.6
6月末	13,654	11.3	22,288.14	11.2	81.1	18.5
7月末	13,304	8.5	21,710.00	8.3	82.1	17.8
8月末	14,177	15.6	23,139.76	15.5	83.2	16.7
9月末	14,289	16.5	23,185.12	15.7	83.7	16.3
10月末	14,151	15.4	22,977.13	14.7	83.7	16.2
11月末	16,289	32.8	26,433.62	31.9	94.9	4.9
12月末	16,930	38.1	27,444.17	37.0	97.2	2.5
2021年 1月末	17,054	39.1	27,663.39	38.1	82.5	17.4
2月末	17,898	46.0	28,966.01	44.6	83.7	16.2
3月末	18,109	47.7	29,178.80	45.6	83.4	16.5
4月末	17,888	45.9	28,812.63	43.8	83.9	16.0
(当期末)						
2021年 5月17日	17,268	40.8	27,824.83	38.9	83.6	16.3

(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。

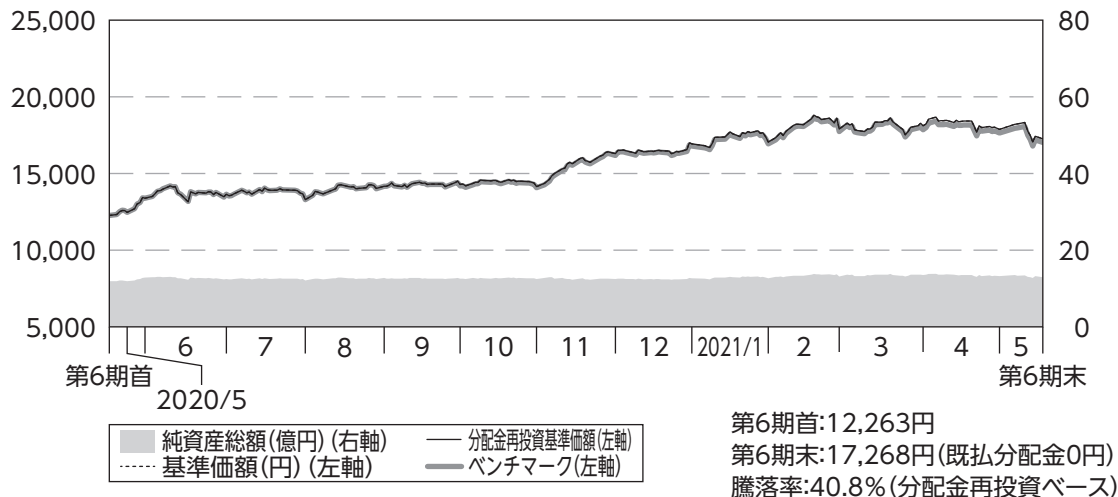
(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

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

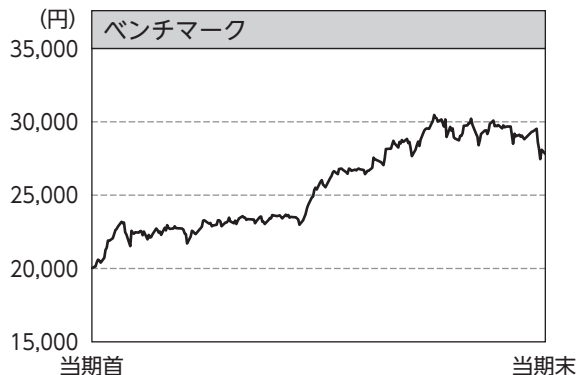


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2020年5月15日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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解除や、新型コロナウイルスワクチンの開発期待などを背景に、国内株式市場は期初から上昇しましたが、世界的な経済活動の再開などが期待される一方、欧米で新規感染者数が増加したことなどが嫌気され、2020年10月まで上値の重い展開が続きました。その後は、新型コロナウイルスワクチンの開発・投与が進んだことなどから、米国株式市場が堅調に推移し、2021年2月にかけて国内株式市場も上昇基調が続きました。期末にかけては、米雇用統計の改善などが好感された一方、米長期金利の上昇や、国内での新型コロナウイルス新規感染者数の増加による緊急事態宣言の発令などが重石となり、国内株式市場は軟調な展開となりました。

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(M)」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(M)」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。

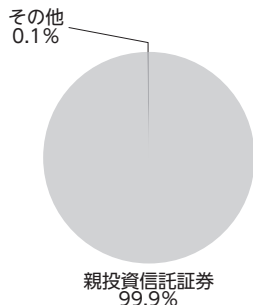
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

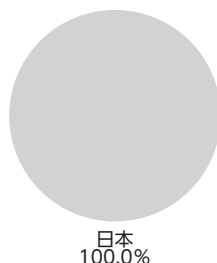
	当期末
	2021年5月17日
日経225インデックスマザーファンド(M)	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

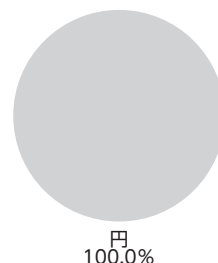
○資産別配分



○国別配分



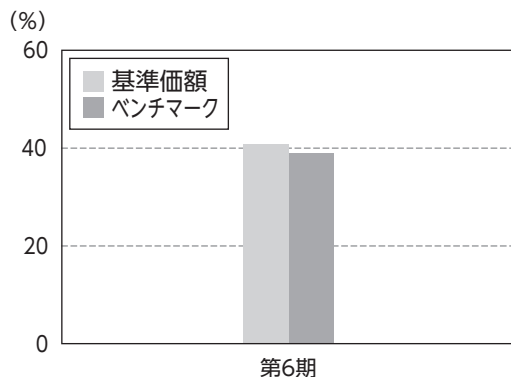
○通貨別配分



(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。

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。



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6期	
	2020年5月16日～2021年5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)	7,268	

(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(M) 受益証券への投資を通じて、日経平均株価(日経225)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
	(2020年5月16日～2021年5月17日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	33円	0.210%	(a) 信託報酬 = $\frac{\text{期中の平均基準価額}}{\text{期中の平均基準価額}} \times \text{信託報酬率}$ 期中の平均基準価額は15,593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)	(14)	(0.088)	
(販売会社)	(14)	(0.088)	
(受託会社)	(5)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.003	(b) 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
(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)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 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
(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	0.006	(d) 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
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	34	0.219	

(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。

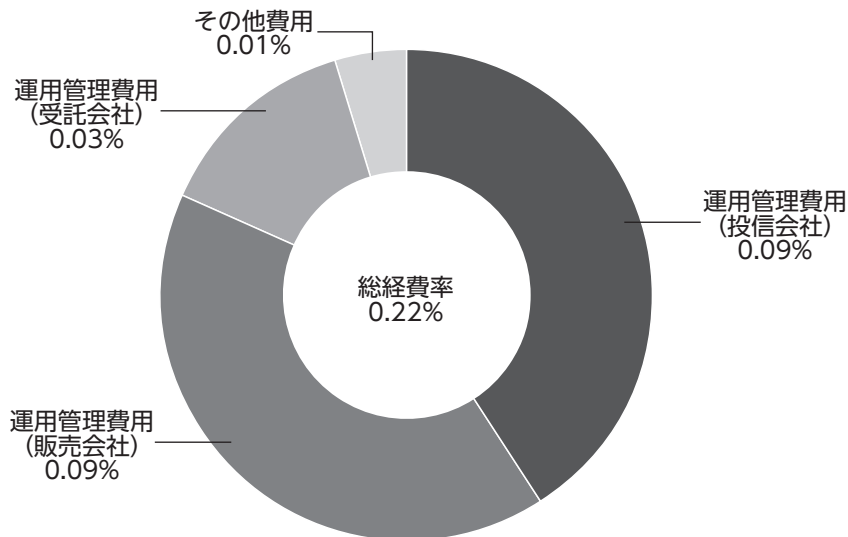
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.22%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 (M)	125,618	441,021	224,678	765,243

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

<日経225インデックスマザーファンド (M) >

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	898,414千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	3,952,942千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	0.22

(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	$\frac{B}{A}$	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 0.368543	百万円 0.368543	% 100.0	百万円 0.368543	百万円 0.368543	% 100.0
コール・ローン	1,153	67	5.8	1,150	68	5.9

(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。

<日経225インデックスマザーファンド (M) >

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 166	百万円 166	% 100.0	百万円 166	百万円 166	% 100.0
コール・ローン	166,698	10,574	6.3	166,782	10,756	6.4

<平均保有割合 27.4%>

(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。

■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(M)>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	百万円 -	百万円 0.3312	百万円 1

(注1) 買付額及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>

種 類	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(M)	千口 441,213	千口 342,153	千円 1,297,960

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、1,217,388千口です。

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(M)	千円 1,297,960	% 98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,924	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	1,316,884	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 2021年5月17日現在
(A) 資 産	1,316,884,913円
コー ル ・ ロ ー ン 等	5,119,545
日経225インデックスマザーファンド(M) (評価額)	1,297,960,019
未 収 入 金	13,805,349
(B) 負 債	18,269,557
未 払 解 約 金	16,863,647
未 払 信 託 報 酬	1,369,915
未 払 利 息	3
そ の 他 未 払 費 用	35,992
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,298,615,356
元 本	752,030,794
次 期 繰 越 損 益 金	546,584,562
(D) 受 益 権 総 口 数	752,030,794口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,268円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月16日 至 2021年5月17日
(A) 配 当 等 収 益	△1,098円
受 取 利 息	28
支 払 利 息	△1,126
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	249,884,966
売 買 損 益	401,126,473
売 買 損 益	△151,241,507
(C) 信 託 報 酬 等	△2,766,353
(D) 当 期 繰 越 損 益 金(A+B+C)	247,117,515
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△21,372,732
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	320,839,779
(配 当 等 相 当 額)	(174,138,426)
(売 買 損 益 相 当 額)	(146,701,353)
(G) 計 (D+E+F)	546,584,562
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	546,584,562
追 加 信 託 差 損 益 金	320,839,779
(配 当 等 相 当 額)	(175,138,314)
(売 買 損 益 相 当 額)	(145,701,465)
分 配 準 備 積 立 金	225,744,783

(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967,501,066円、期中追加設定元本額は456,511,337円、期中一部解約元本額は671,981,609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)	16,283,317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)	179,977,497円
(C) 収益調整金額	320,839,779円
(D) 分配準備積立金額	29,483,969円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	546,584,562円
(F) 期末残存口数	752,030,794口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	7,268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

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（M）

運用報告書

第12期（決算日 2021年5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2009年5月18日から無期限です。
運用方針	中長期的な信託財産の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に上場されている株式のうち日経平均株価（日経225）に採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含みます。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		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率			
第8期(2017年5月15日)	25,057	22.9	19,869.85	20.7	92.7	5.9	百万円 10,144
第9期(2018年5月15日)	29,315	17.0	22,818.02	14.8	95.3	4.6	6,453
第10期(2019年5月15日)	27,804	△5.2	21,188.56	△7.1	88.1	11.9	5,241
第11期(2020年5月15日)	26,877	△3.3	20,037.47	△5.4	79.1	20.9	4,219
第12期(2021年5月17日)	37,935	41.1	27,824.83	38.9	83.7	16.3	4,618

(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		株式組入比率	株式先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2020年5月15日	26,877	—	20,037.47	—	79.1	20.9
5月末	29,324	9.1	21,877.89	9.2	79.4	20.6
6月末	29,935	11.4	22,288.14	11.2	81.2	18.6
7月末	29,174	8.5	21,710.00	8.3	82.1	17.8
8月末	31,095	15.7	23,139.76	15.5	83.2	16.7
9月末	31,346	16.6	23,185.12	15.7	83.7	16.3
10月末	31,048	15.5	22,977.13	14.7	83.7	16.2
11月末	35,748	33.0	26,433.62	31.9	94.9	4.9
12月末	37,161	38.3	27,444.17	37.0	97.3	2.5
2021年1月末	37,441	39.3	27,663.39	38.1	82.5	17.4
2月末	39,302	46.2	28,966.01	44.6	83.7	16.2
3月末	39,773	48.0	29,178.80	45.6	83.5	16.5
4月末	39,294	46.2	28,812.63	43.8	84.0	16.0
(当期末) 2021年5月17日	37,935	41.1	27,824.83	38.9	83.7	16.3

(注1) 騰落率は期首比です。

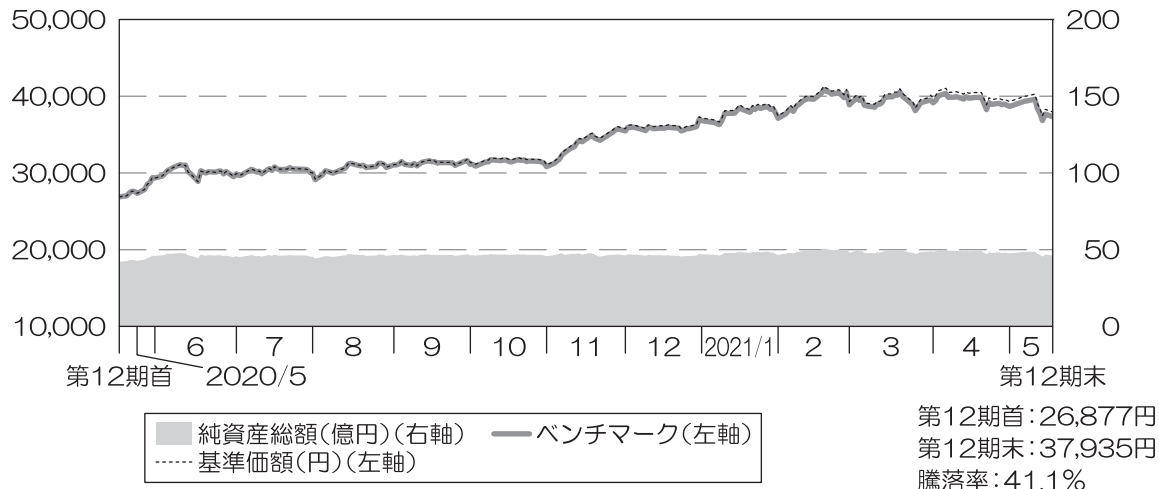
(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

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

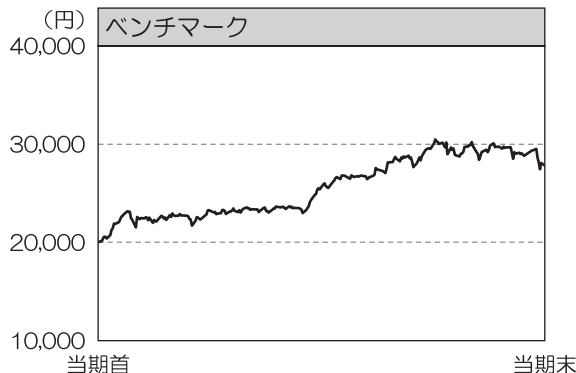


(注)ベンチマークは、2020年5月15日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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解除や、新型コロナウイルスワクチンの開発期待などを背景に、国内株式市場は期初から上昇しましたが、世界的な経済活動の再開などが期待される一方、欧米で新規感染者数が増加したことが嫌気され、2020年10月まで上値の重い展開が続きました。その後は、新型コロナウイルスワクチンの開発・投与が進んだことなどから、米国株式市場が堅調に推移し、2021年2月にかけて国内株式市場も上昇基調が続きました。期末にかけては、米雇用統計の改善などが好感された一方、米長期金利の上昇や、国内での新型コロナウイルス新規感染者数の増加による緊急事態宣言の発令などが重石となり、国内株式市場は軟調な展開となりました。

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

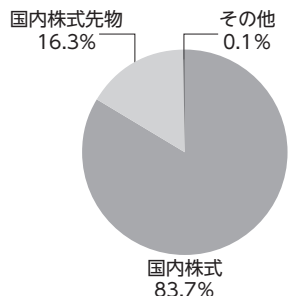
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	日経平均株価指数先物 2106	日本	15.0%
2	ファーストリテイリング	日本	9.3%
3	ソフトバンクグループ	日本	5.5%
4	東京エレクトロン	日本	4.8%
5	ファナック	日本	2.7%
6	KDDI	日本	2.3%

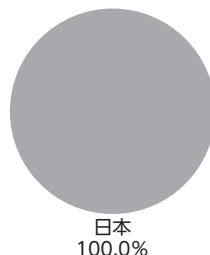
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ダイキン工業	日本	2.3%
8	アドバンテスト	日本	2.0%
9	信越化学工業	日本	2.0%
10	エムスリー	日本	1.8%
組入銘柄数		227	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

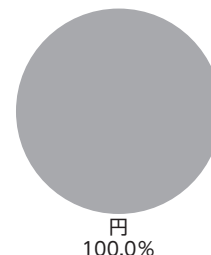
○資産別配分



○国別配分



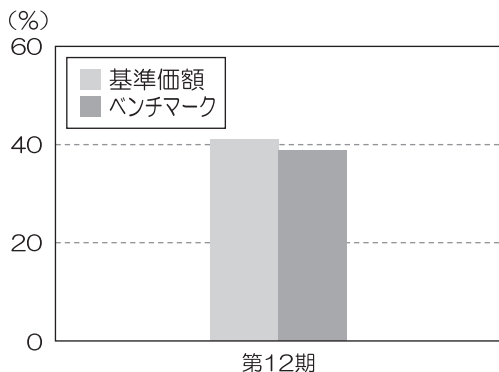
○通貨別配分



(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16.3%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。



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、わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち日経平均株価(日経225)に採用されている銘柄への投資を通じて、日経平均株価(日経225)と連動する投資成果を目指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16日～2021年5月17日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.003%	(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
(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)	(1)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(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
(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	0	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
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	1	0.003	

(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(34,220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 30 (16)	千円 67,032 (一)	千株 213	千円 831,382

(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 4,531	百万円 4,899	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) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	898,414千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	3,952,942千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	0.22

(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	$\frac{B}{A}$	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 166	百万円 166	% 100.0	百万円 166	百万円 166	% 100.0
コール・ローン	166,698	10,574	6.3	166,782	10,756	6.4

(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	百万円 -	百万円 0.3312	百万円 1

(注1) 買付額及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	当期中(前期末)	当 期 末		銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業(0.1%)				三井化学	1.2	1	3,620
日本水産	6	5	2,660	三菱ケミカルホールディングス	3	2.5	2,139
マルハニチロ	0.6	0.5	1,280	宇部興産	0.6	0.5	1,195
鉱業(0.0%)				日本化薬	6	—	—
INPEX	2.4	2	1,598	花王	6	5	33,825
建設業(1.7%)				D I C	0.6	0.5	1,448
コムシスホールディングス	6	5	16,000	富士フイルムホールディングス	6	5	35,715
大成建設	1.2	1	3,875	資生堂	6	5	38,485
大林組	6	5	4,740	日東電工	6	5	42,650
清水建設	6	5	4,445	医薬品(7.1%)			
長谷工コーポレーション	1.2	1	1,538	協和キリン	6	5	16,675
鹿島建設	3	2.5	3,620	武田薬品工業	6	5	18,840
大和ハウス工業	6	5	16,210	アステラス製薬	30	25	42,212
積水ハウス	6	5	11,422	大日本住友製薬	6	5	10,140
日揮ホールディングス	6	5	5,215	塩野義製薬	6	5	28,855
食料品(3.5%)				中外製薬	6	15	61,170
日清製粉グループ本社	6	5	9,100	エーザイ	6	5	34,415
明治ホールディングス	1.2	1	6,750	第一三共	6	15	39,495
日本ハム	3	2.5	11,462	大塚ホールディングス	6	5	22,075
サッポロホールディングス	1.2	1	2,205	石油・石炭製品(0.2%)			
アサヒグループホールディングス	6	5	25,165	出光興産	2.4	2	5,390
キリンホールディングス	6	5	10,712	ENEOSホールディングス	6	5	2,310
宝ホールディングス	6	5	7,090	ゴム製品(0.7%)			
キッコーマン	6	5	34,000	横浜ゴム	3	2.5	5,500
味の素	6	5	11,937	ブリヂストン	6	5	23,285
ニチレイ	3	2.5	7,150	ガラス・土石製品(1.2%)			
日本たばこ産業	6	5	10,857	A G C	1.2	1	4,940
繊維製品(0.2%)				日本板硝子	0.6	0.5	310
東洋紡	0.6	0.5	694	日本電気硝子	1.8	1.5	3,990
ユニチカ	0.6	0.5	186	住友大阪セメント	0.6	0.5	1,655
帝人	1.2	1	1,826	太平洋セメント	0.6	0.5	1,295
東レ	6	5	3,422	東海カーボン	6	5	8,700
パルプ・紙(0.1%)				T O T O	3	2.5	14,125
王子ホールディングス	6	5	3,520	日本碍子	6	5	9,895
日本製紙	0.6	0.5	704	鉄鋼(0.1%)			
化学(7.9%)				日本製鉄	0.6	0.5	1,079
クラレ	6	5	5,755	神戸製鋼所	0.6	0.5	379
旭化成	6	5	6,130	ジェイ エフ イー ホールディングス	0.6	0.5	766
昭和電工	0.6	0.5	1,805	大太平洋金属	0.6	0.5	953
住友化学	6	5	2,900	非鉄金属(0.9%)			
日産化学	6	5	27,750	日本軽金属ホールディングス	6	0.5	1,082
東ソー	3	2.5	5,127	三井金属鉱業	0.6	0.5	1,640
トクヤマ	1.2	1	2,299	東邦亜鉛	0.6	0.5	1,018
デンカ	1.2	1	4,175	三菱マテリアル	0.6	0.5	1,139
信越化学工業	6	5	90,525	住友金属鉱山	3	2.5	11,735

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
DOWAホールディングス	1.2	1	4,615	SCREENホールディングス	1.2	1	9,430
古河電気工業	0.6	0.5	1,469	キヤノン	9	7.5	18,873
住友電気工業	6	5	7,997	リコー	6	5	6,110
フジクラ	6	5	2,370	東京エレクトロン	6	5	223,500
金属製品 (0.2%)				輸送用機器 (4.4%)			
SUMCO	0.6	0.5	1,224	デンソー	6	5	35,810
東洋製罐グループホールディングス	6	5	6,515	三井E&Sホールディングス	0.6	0.5	244
機械 (4.9%)				川崎重工業	0.6	0.5	1,264
日本製鋼所	1.2	1	2,444	日産自動車	6	5	2,689
オークマ	1.2	1	5,540	いすゞ自動車	3	2.5	3,377
アマダ	6	5	5,505	トヨタ自動車	6	5	43,240
小松製作所	6	5	16,255	日野自動車	6	5	4,830
住友重機械工業	1.2	1	3,230	三菱自動車工業	0.6	0.5	154
日立建機	6	5	17,625	マツダ	1.2	1	873
クボタ	6	5	12,792	本田技研工業	12	10	32,380
荏原製作所	1.2	1	5,010	スズキ	6	5	21,805
ダイキン工業	6	5	104,850	SUBARU	6	5	10,257
日本精工	6	5	5,020	ヤマハ発動機	6	5	14,860
NTN	6	5	1,555	精密機器 (3.3%)			
ジェイテクト	6	5	5,310	テルモ	24	20	78,720
日立造船	1.2	1	713	ニコン	6	5	5,485
三菱重工業	0.6	0.5	1,614	オリンパス	24	20	41,670
IHI	0.6	0.5	1,182	シチズン時計	6	5	2,050
電気機器 (22.1%)				その他製品 (2.1%)			
日清紡ホールディングス	6	5	4,480	パンダイナムコホールディングス	6	5	38,320
コニカミノルタ	6	5	2,795	凸版印刷	3	2.5	4,575
ミネベアミツミ	6	5	13,545	大日本印刷	3	2.5	5,710
日立製作所	1.2	1	5,384	ヤマハ	6	5	30,900
三菱電機	6	5	8,195	電気・ガス業 (0.2%)			
富士電機	1.2	1	4,805	東京電力ホールディングス	0.6	0.5	173
安川電機	6	5	23,625	中部電力	0.6	0.5	683
オムロン	6	5	40,550	関西電力	0.6	0.5	542
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1.2	1	2,877	東京瓦斯	1.2	1	2,323
日本電気	0.6	0.5	2,575	大阪瓦斯	1.2	1	2,218
富士通	0.6	0.5	8,412	陸運業 (1.6%)			
沖電気工業	0.6	0.5	475	東武鉄道	1.2	1	2,887
セイコーエプソン	12	10	18,560	東急	3	2.5	3,642
パナソニック	6	5	6,045	小田急電鉄	3	2.5	7,300
シャープ	—	5	9,140	京王電鉄	1.2	1	7,010
ソニーグループ	6	5	51,650	京成電鉄	3	2.5	8,012
TDK	6	5	67,200	東日本旅客鉄道	0.6	0.5	3,771
アルプスアルパイン	6	5	5,620	西日本旅客鉄道	0.6	0.5	3,045
横河電機	6	5	8,900	東海旅客鉄道	0.6	0.5	7,927
アドバンテスト	12	10	90,800	日本通運	0.6	0.5	4,320
カシオ計算機	6	5	8,825	ヤマトホールディングス	6	5	14,940
ファナック	6	5	122,875	海運業 (0.1%)			
京セラ	12	10	66,120	日本郵船	0.6	0.5	2,137
太陽誘電	6	5	23,075	商船三井	0.6	0.5	2,157

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
川崎汽船	0.6	0.5	1,351
空運業(0.0%)			
ANAホールディングス	0.6	0.5	1,243
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
三菱倉庫	3	2.5	8,350
情報・通信業(13.0%)			
ネクソン	—	10	26,730
Zホールディングス	2.4	2	941
トレンドマイクロ	6	5	26,700
スカパーJ SATホールディングス	0.6	0.5	216
日本電信電話	2.4	2	5,702
KDDI	36	30	105,960
ソフトバンク	—	5	7,142
NTTドコモ	0.6	—	—
東宝	0.6	0.5	2,140
エヌ・ティ・ティ・データ	30	25	41,400
コナミホールディングス	6	5	31,200
ソフトバンクグループ	36	30	252,930
卸売業(2.1%)			
双日	0.6	0.5	165
伊藤忠商事	6	5	16,465
丸紅	6	5	4,610
豊田通商	6	5	24,400
三井物産	6	5	11,982
住友商事	6	5	7,535
三菱商事	6	5	14,667
小売業(12.6%)			
J. フロント リテイリング	3	2.5	2,595
三越伊勢丹ホールディングス	6	5	3,845
セブン&アイ・ホールディングス	6	5	23,950
ファミリーマート	24	—	—
高島屋	3	2.5	3,025
丸井グループ	6	5	9,975
イオン	6	5	14,990
ファーストリテイリング	6	5	430,450
銀行業(0.6%)			
コンソルディア・フィナンシャルグループ	6	5	2,115
新生銀行	0.6	0.5	830
あおぞら銀行	0.6	0.5	1,260
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6	5	3,062
りそなホールディングス	0.6	0.5	236
三井住友トラスト・ホールディングス	0.6	0.5	1,936
三井住友フィナンシャルグループ	0.6	0.5	1,979
千葉銀行	6	5	3,610

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ふくおかフィナンシャルグループ	1.2	1	2,026
静岡銀行	6	5	4,545
みずほフィナンシャルグループ	6	0.5	830
証券・商品先物取引業(0.3%)			
大和証券グループ本社	6	5	3,073
野村ホールディングス	6	5	2,908
松井証券	6	5	4,235
保険業(0.7%)			
SOMPOホールディングス	1.5	1.2	5,221
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	1.8	1.5	4,983
ソニーフィナンシャルホールディングス	1.2	—	—
第一生命ホールディングス	0.6	0.5	1,021
東京海上ホールディングス	3	2.5	13,612
T&Dホールディングス	1.2	1	1,406
その他金融業(0.5%)			
クレディセゾン	6	5	6,655
日本取引所グループ	—	5	12,482
不動産業(1.2%)			
東急不動産ホールディングス	6	5	3,190
三井不動産	6	5	12,342
三菱地所	6	5	9,027
東京建物	3	2.5	4,147
住友不動産	6	5	18,015
サービス業(6.2%)			
エムスリー	14.4	12	83,484
ディー・エヌ・エー	1.8	1.5	3,007
電通グループ	6	5	17,350
サイバーエージェント	1.2	4	8,216
楽天グループ	6	5	6,640
リクルートホールディングス	18	15	71,805
日本郵政	6	5	4,627
セコム	6	5	42,995
合計	株数・金額	株数	金額
		1,077	910 3,863,121
	銘柄数<比率>	225	225 <83.7%>

(注1) ()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) < >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	売 建 額
国内	百万円	百万円
日 経 2 2 5	694	—
日 経 2 2 5 m i n i	58	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 3,863,121	% 83.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	784,433	16.9
投 資 信 託 財 産 総 額	4,647,554	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 2021年5月17日現在
(A) 資 産	4,647,107,552円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	711,538,582
株 式(評価額)	3,863,121,650
未 収 配 当 金	27,386,320
差 入 委 託 証 拠 金	45,061,000
(B) 負 債	28,988,351
未 払 金	12,669,778
未 払 解 約 金	16,318,130
未 払 利 息	443
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,618,119,201
元 本	1,217,388,314
次 期 繰 越 損 益 金	3,400,730,887
(D) 受 益 権 総 口 数	1,217,388,314口
1万口当たり基準価額(C/D)	37,935円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月16日 至 2021年5月17日
(A) 配 当 等 収 益	65,667,152円
受 取 配 当 金	65,929,300
受 取 利 息	2,327
そ の 他 収 益 金	2,139
支 払 利 息	△266,614
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,290,029,934
売 買 益	1,327,761,346
売 買 損	△37,731,412
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	240,766,304
取 引 益	259,445,828
取 引 損	△18,679,524
(D) そ の 他 費 用	△1,495
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	1,596,461,895
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	2,649,432,367
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	318,731,351
(H) 解 約 差 損 益 金	△1,163,894,726
(I) 計 (E+F+G+H)	3,400,730,887
次 期 繰 越 損 益 金(I)	3,400,730,887

(注1) (B) 有価証券売買損益及び(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1,569,828,148円、期中追加設定元本額は126,848,562円、期中一部解約元本額は479,288,396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インデックスファンド 875,234,625円

日経225インデックス e 342,153,689円

お知らせ

該当事項はありません。