

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／特殊型(絶対収益追求型)	
信託期間	信託期間は2017年10月16日から2025年7月10日までです。	
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	米国株式LS ファンド(SMA専用)	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。
	米国株式LS マザーファンド	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社(SPC)の発行する米ドル建債券を主要投資対象とします。
組入制限	米国株式LS ファンド(SMA専用)	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。
	米国株式LS 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。
分配方針	原則として、毎年7月10日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。 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。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

米国株式LSファンド (SMA専用)

運用報告書(全体版)

第6期(決算日 2023年7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。
- ・ 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			債券組入比率	債券先物率	純資産額
	(分配落)	税金 分配金	騰落 中率			
	円	円	%	%	%	百万円
第2期(2019年7月10日)	10,568	0	11.4	98.0	—	612
第3期(2020年7月10日)	9,987	0	△5.5	96.7	—	822
第4期(2021年7月12日)	9,554	0	△4.3	97.5	—	482
第5期(2022年7月11日)	10,244	0	7.2	98.2	—	533
第6期(2023年7月10日)	10,559	0	3.1	97.3	—	247

(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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物率
	騰落率	騰落率		
(当期首) 2022年 7月11日	円	%	%	%
7月末	10,244	—	98.2	—
8月末	10,222	△0.2	96.9	—
9月末	10,125	△1.2	99.7	—
10月末	10,445	2.0	102.1	—
11月末	10,710	4.5	100.1	—
12月末	10,349	1.0	92.0	—
2023年 1月末	10,286	0.4	91.8	—
2月末	10,059	△1.8	92.2	—
3月末	10,496	2.5	99.2	—
4月末	10,835	5.8	95.8	—
5月末	10,585	3.3	97.0	—
6月末	10,737	4.8	101.2	—
7月末	10,611	3.6	101.0	—
(当期末) 2023年 7月10日	10,559	3.1	97.3	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

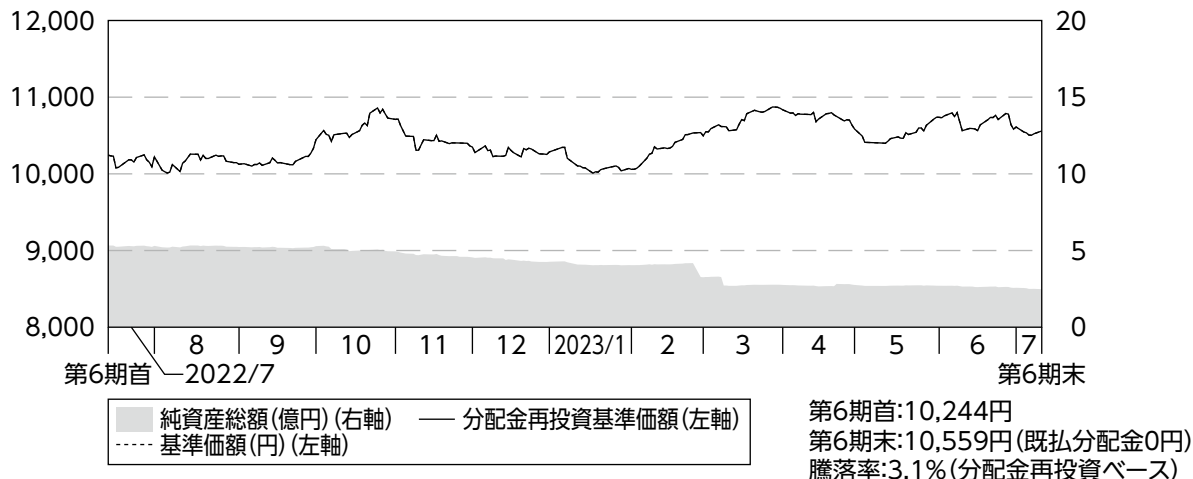
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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は、2022年7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

主要投資対象である米ドル建債券において、Two Sigmaグループの運用会社が活用する計量モデルに基づき銘柄選択を行いました。当期の基準価額は上昇しました。特に、2022年9月や10月、2023年2月や3月に大きくプラスのリターンを計上しました。

投資環境

当期の米国株式市場は上昇しました。金融引き締めによる景気後退リスクや欧米金融機関に対する信用不安を警戒する局面もありましたが、先進国の物価指標の鈍化を背景に世界的な利上げサイクルが終盤に近いとの見方が強まったことや、米国のハイテク企業の好決算を受けて上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

「米国株式LSマザーファンド」受益証券を高位に組み入れる運用を行いました。

【「米国株式LSマザーファンド」の運用経過】

米ドル建債券の組入比率を高位に保つとともに、対円での為替ヘッジ(米ドル売り/円買い)を行い、米ドル/円の為替変動に伴うリスクの低減を図りました。米ドル建債券においては、Two Sigmaグループの運用会社が計量モデルを活用し、米国の金融商品取引所等に上場している株式等を対象にしたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行い、期初はロング・エクスポージャー、ショート・エクスポージャーともに米ドル建債券の時価総額比で170%前後にて運用を開始しましたが、期中は概ねロング・エクスポージャー、ショート・エクスポージャーともに140%程度から150%程度で推移しました。

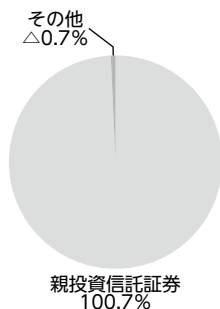
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

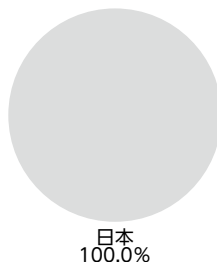
	当期末
	2023年7月10日
米国株式LSマザーファンド	100.7%
その他	△0.7%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

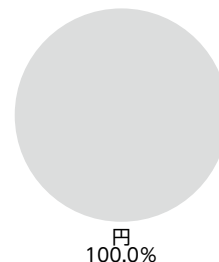
○資産別配分



○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	
	2022年7月12日~2023年7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)	835

(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

米国株式LSマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社(SPC)の発行する米ドル建債券(以下「米ドル建債券」といいます。)に投資し、米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建(ロングポジション)と売建(ショートポジション)を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行います。

実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年7月12日~2023年7月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	39円	0.373%	(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10,455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)	(0.197)	
(販売会社)	(15)	(0.143)	
(受託会社)	(3)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	—	—	(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)	(—)	(—)	
(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 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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	3	0.031	(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)	(3)	(0.025)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(—)	(—)	
合計	42	0.404	

(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。

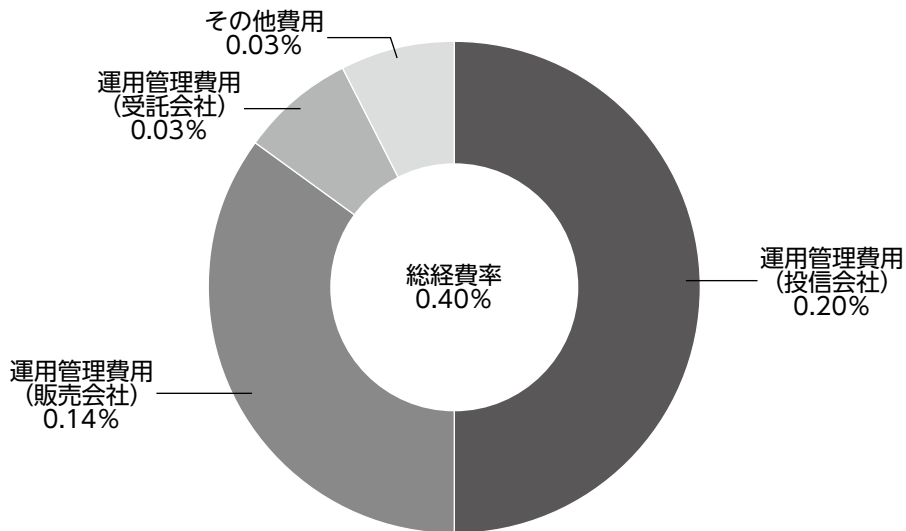
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.40%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)実質的に投資対象とする米ドル建債券の価格に反映される費用等は含まれておりません。

(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
米国株式LSマザーファンド	千口 18,779	千円 20,556	千口 295,863	千円 318,339

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 0.000096	百万円 0.000096	% 100.0	百万円 0.000096	百万円 0.000096	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	475	56	11.8	475	56	11.8

(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。

<米国株式LS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
為 替 先 物 取 引	百万円 250,030	百万円 250,030	% 100.0	百万円 248,690	百万円 248,690	% 100.0
為 替 直 物 取 引	—	—	—	1,754	1,754	100.0
金 銭 信 託	0.039983	0.039983	100.0	0.039983	0.039983	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	198,518	23,422	11.8	198,848	23,348	11.7

<平均保有割合 1.8%>

(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。

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
米 国 株 式 L S マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 507,293	千口 230,209	千円 249,754

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、20,689,301千口です。

* 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
米 国 株 式 L S マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 249,754	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,956	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	251,710	100.0

(注1) 米国株式LSマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(21,678,539千円)の投資信託財産総額(23,320,847千円)に対する比率は93.0%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=142.54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 2023年7月10日現在
(A)資 産	251,710,187円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,378,825
米国株式LSマザーファンド(評価額)	249,754,001
未 収 入 金	577,361
(B)負 債	3,773,184
未 払 解 約 金	3,195,805
未 払 信 託 報 酬	569,077
未 払 利 息	1
そ の 他 未 払 費 用	8,301
(C)純 資 産 総 額(A-B)	247,937,003
元 本	234,818,694
次 期 繰 越 損 益 金	13,118,309
(D)受 益 権 総 口 数	234,818,694口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,559円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年7月12日 至 2023年7月10日
(A)配 当 等 収 益	△516円
受 取 利 息	1
支 払 利 息	△517
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	8,109,609
売 買 益	15,128,273
売 買 損	△7,018,664
(C)信 託 報 酬 等	△1,520,696
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	6,588,397
(E)前 期 繰 越 損 益 金	5,250,863
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,279,049
(配 当 等 相 当 額)	(7,772,306)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△6,493,257)
(G)計 (D+E+F)	13,118,309
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	13,118,309
追 加 信 託 差 損 益 金	1,279,049
(配 当 等 相 当 額)	(7,772,305)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△6,493,256)
分 配 準 備 積 立 金	11,839,519
繰 越 損 益 金	△259

(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520,301,564円、期中追加設定元本額は23,342,119円、期中一部解約元本額は308,824,989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)		－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)		6,585,889円
(C)	収益調整金額		7,772,305円
(D)	分配準備積立金額		5,253,630円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		19,611,824円
(F)	期末残存口数		234,818,694口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		835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。

米国株式LSマザーファンド

運用報告書

第6期（決算日 2023年7月10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2017年10月10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	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社(SPC)の発行する米ドル建債券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。

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	期 騰 落 中 率	債 券 先 物 率	純 資 産 額	
					債 組 入 比 率
第2期(2019年7月10日)	円 10,662	% 12.1	% 97.6	% —	百万円 27,261
第3期(2020年7月10日)	10,113	△5.1	96.8	—	24,162
第4期(2021年7月12日)	9,712	△4.0	97.7	—	18,398
第5期(2022年7月11日)	10,481	7.9	98.4	—	21,178
第6期(2023年7月10日)	10,849	3.5	96.6	—	22,446

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 組 入 比 率	債 券 先 物 率
(当 期 首) 2022年 7月11日	円 10,481	% —	% 98.4	% —
7月末	10,460	△0.2	97.2	—
8月末	10,364	△1.1	99.9	—
9月末	10,696	2.1	102.2	—
10月末	10,972	4.7	100.2	—
11月末	10,606	1.2	91.8	—
12月末	10,545	0.6	91.9	—
2023年 1月末	10,318	△1.6	92.5	—
2月末	10,770	2.8	99.6	—
3月末	11,123	6.1	96.0	—
4月末	10,868	3.7	96.9	—
5月末	11,027	5.2	101.5	—
6月末	10,902	4.0	101.2	—
(当 期 末) 2023年 7月10日	10,849	3.5	96.6	—

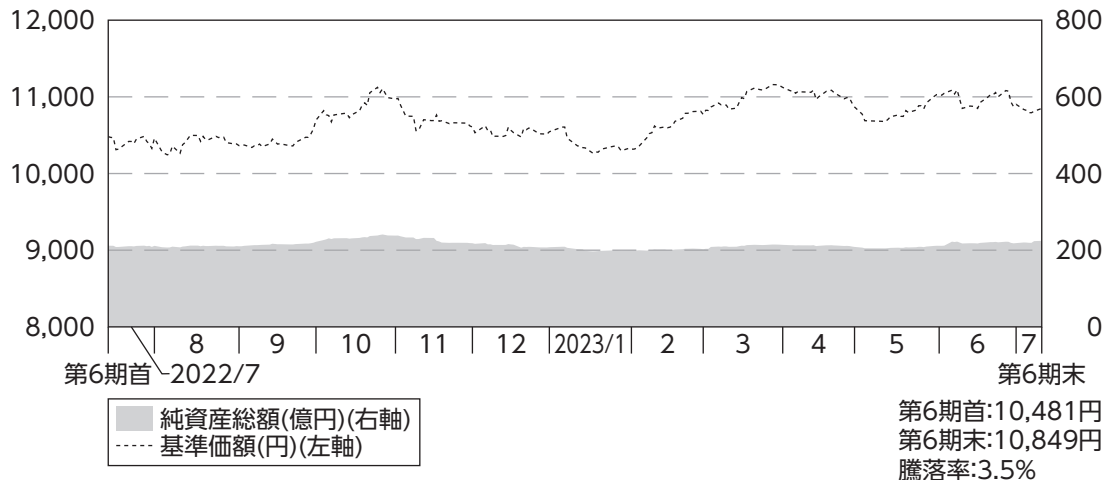
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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



基準価額の主な変動要因

主要投資対象である米ドル建債券において、Two Sigmaグループの運用会社が活用する計量モデルに基づき銘柄選択を行いました。当期の基準価額は上昇しました。特に、2022年9月や10月、2023年2月や3月に大きくプラスのリターンを計上しました。

投資環境

当期の米国株式市場は上昇しました。金融引き締めによる景気後退リスクや欧米金融機関に対する信用不安を警戒する局面もありましたが、先進国の物価指標の鈍化を背景に世界的な利上げサイクルが終盤に近いとの見方が強まったことや、米国のハイテク企業の好決算を受けて上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

米ドル建債券の組入比率を高位に保つとともに、対円での為替ヘッジ(米ドル売り／円買い)を行い、米ドル／円の為替変動に伴うリスクの低減を図りました。米ドル建債券においては、Two Sigmaグループの運用会社が計量モデルを活用し、米国の金融商品取引所等に上場している株式等を対象にしたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行い、期初はロング・エクスポージャー、ショート・エクスポージャーともに米ドル建債券の時価総額比で170%前後にて運用を開始しましたが、期中は概ねロング・エクスポージャー、ショート・エクスポージャーともに140%程度から150%程度で推移しました。

当ファンドの組入資産の内容

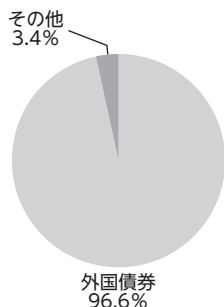
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 004 10/18/27	アイルランド	96.6%
2	————	—	—
3	————	—	—
4	————	—	—
5	————	—	—
6	————	—	—

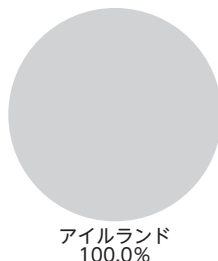
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	————	—	—
8	————	—	—
9	————	—	—
10	————	—	—
組入銘柄数		1	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

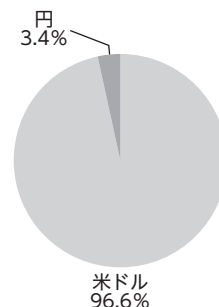
○資産別配分



○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いません。

今後の運用方針

UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社(SPC)の発行する米ドル建債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等の買建(ロングポジション)と売建(ショートポジション)を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行います。

組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年7月12日~2023年7月10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)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(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)	3 (3) (-) (-)	0.025 (0.025) (-) (-)	(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	3	0.025	

(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(10,720円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外国	ア メ リ カ	社債券(投資法人債券を含む)	千米ドル -	千米ドル 11,958

(注1) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 先 物 取 引	百万円 250,030	百万円 250,030	% 100.0	百万円 248,690	百万円 248,690	% 100.0
為 替 直 物 取 引	-	-	-	1,754	1,754	100.0
金 銭 信 託	0.039983	0.039983	100.0	0.039983	0.039983	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	198,518	23,422	11.8	198,848	23,348	11.7

(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(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当		期		末			
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千 米 ド ル 123,000	千 米 ド ル 152,087	千 円 21,678,539	% 96.6	% —	% —	% 96.6	% —
合 計	123,000	152,087	21,678,539	96.6	—	—	96.6	—

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

銘 柄	利 率 (%)	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
			期		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)	
(アメリカ) 普通社債券(含む投資法人債券) STAR HELIOS 004 10/18/27	—	千 米 ド ル 123,000	千 米 ド ル 152,087	千 円 21,678,539	2027/10/18
合 計				21,678,539	

(注) 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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
公 社 債	千 円 21,678,539	% 93.0	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,642,308	7.0	
投 資 信 託 財 産 総 額	23,320,847	100.0	

(注1) 当期末における外貨建純資産(21,678,539千円)の投資信託財産総額(23,320,847千円)に対する比率は93.0%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=142.54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 2023年7月10日現在
(A)資 産	44,870,267,916円
コール・ローン等	1,320,676,638
公 社 債(評価額)	21,678,539,278
未 収 入 金	21,871,052,000
(B)負 債	22,423,471,984
未 払 金	22,422,353,600
未 払 解 約 金	1,117,283
未 払 利 息	1,101
(C)純 資 産 総 額(A-B)	22,446,795,932
元 本	20,689,301,202
次 期 繰 越 損 益 金	1,757,494,730
(D)受 益 権 総 口 数	20,689,301,202口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,849円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年7月12日 至 2023年7月10日
(A)配 当 等 収 益	1,165円
受 取 利 息	391,125
支 払 利 息	△389,960
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	676,912,029
売 買 益	5,967,247,330
売 買 損	△5,290,335,301
(C)そ の 他 費 用	△5,336,052
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	671,577,142
(E)前 期 繰 越 損 益 金	971,800,991
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	313,432,780
(G)解 約 差 損 益 金	△199,316,183
(H) 計 (D+E+F+G)	1,757,494,730
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,757,494,730

(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) (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20,206,233,087円、期中追加設定元本額は3,934,553,381円、期中一部解約元本額は3,451,485,266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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	14,952,737,882円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,913,062,233円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,462,094,500円
コア投資戦略ファンド(切替型)	898,365,040円
FOFs用米国株式LSファンドS(適格機関投資家専用)	478,317,521円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	399,064,145円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,116,183円
米国株式LSファンド(SMA専用)	230,209,237円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	88,334,461円

お知らせ

該当事項はありません。