

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	
信託期間	信託期間は2020年10月29日から2030年3月11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	米国株式デイトレンド戦略ファンド	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。
	米国株式デイトレンド戦略マザーファンド	主として米国株式デイトレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券を主要投資対象とします。
組入制限	米国株式デイトレンド戦略ファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	米国株式デイトレンド戦略マザーファンド	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。	

## 米国株式デイトレンド戦略ファンド

### 運用報告書(全体版)

第4期(決算日 2024年3月11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。
- ・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			債券組入比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税金 分配金	騰落 中率			
設定日(2020年10月29日)	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 10,519
第1期(2021年 3月10日)	9,313	0	△6.9	97.9	—	26,792
第2期(2022年 3月10日)	7,942	0	△14.7	97.5	—	6,551
第3期(2023年 3月10日)	8,838	0	11.3	98.6	—	4,450
第4期(2024年 3月11日)	8,805	0	△0.4	97.7	—	2,088

(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	債券先物比率
	騰落率			
(当期首) 2023年 3月10日	円 8,838	% —	% 98.6	% —
3月末	8,759	△0.9	98.6	—
4月末	8,791	△0.5	98.1	—
5月末	8,835	△0.0	99.0	—
6月末	8,839	0.0	98.7	—
7月末	8,782	△0.6	98.5	—
8月末	8,761	△0.9	97.2	—
9月末	8,775	△0.7	98.2	—
10月末	8,758	△0.9	98.1	—
11月末	8,803	△0.4	98.1	—
12月末	8,794	△0.5	98.3	—
2024年 1月末	8,772	△0.7	98.9	—
2月末	8,817	△0.2	98.7	—
(当期末) 2024年 3月11日	8,805	△0.4	97.7	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

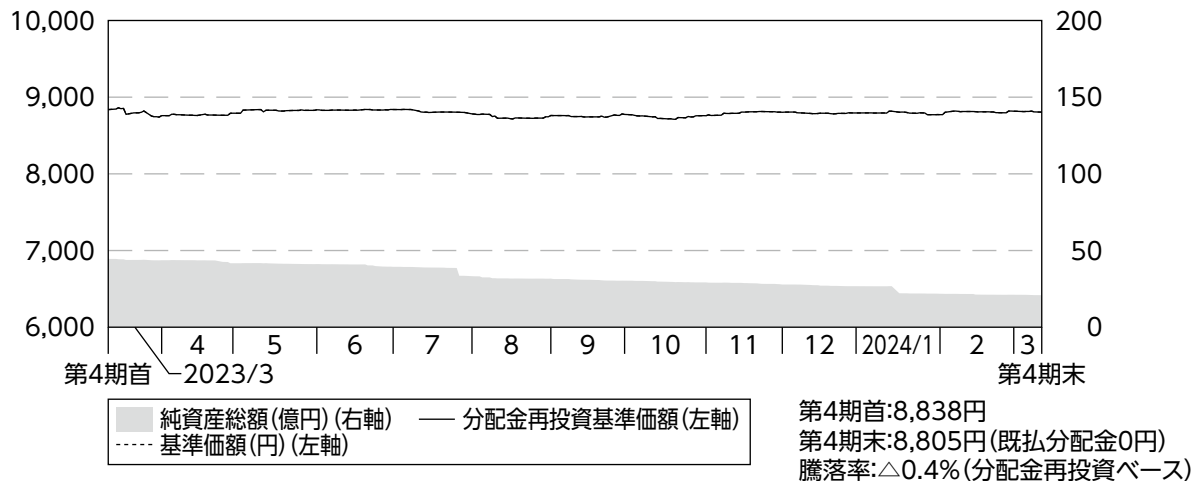
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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



- (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、2023年3月10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

当期の米国株式デイリートレンド戦略※のリターンがプラスとなりましたが、信託報酬などの影響により当ファンドの基準価額は下落しました。

※米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までには解消する戦略です。

## 投資環境

---

米国株式市場は、CPI(消費者物価指数)の伸びが鈍化したことでFRB(米連邦準備理事会)による利上げの休止が期待されたことや、米国景気の軟着陸期待の高まりなどから2023年7月にかけて上昇しましたが、その後は大手格付会社が米国債の格下げを発表したことや、FRBが政策金利を長期間高水準に維持するとの見方が強まったことなどから軟調に推移しました。11月以降は、労働需給の軟化、インフレ鈍化を示す指標を受けて長期金利が低下したことや、FRBによる早期の利下げ転換への期待が高まったことなどから上昇しました。

## 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、「米国株式デイリートレンド戦略マザーファンド」受益証券の組み入れにより行いました。

### 【「米国株式デイリートレンド戦略マザーファンド」の運用経過】

主として米国株式デイリートレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指しました。

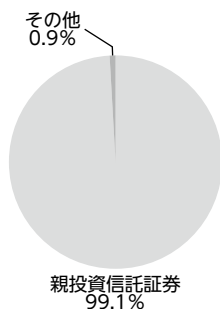
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

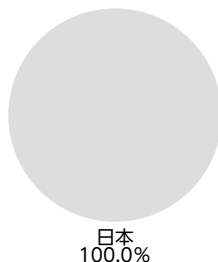
	当期末
	2024年3月11日
米国株式デイリートレンド戦略マザーファンド	99.1%
その他	0.9%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

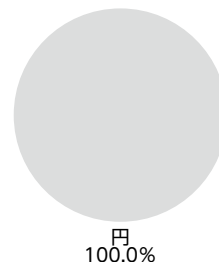
### ○資産別配分



### ○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4期	
	2023年3月11日~2024年3月11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)	—

(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

米国株式デイリートレンド戦略マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国株式デイリートレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券(以下、「円建債券」といいます。)に投資します。

円建債券への実質投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。

# 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2023年3月11日~2024年3月11日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	65円	0.739%	(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8,790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)	(0.243)	
(販売会社)	(41)	(0.463)	
(受託会社)	(3)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	—	—	(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)	(—)	(—)	
(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 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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	4	0.048	(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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(4)	(0.042)	
(監査費用)	(0)	(0.006)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	69	0.787	

(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。

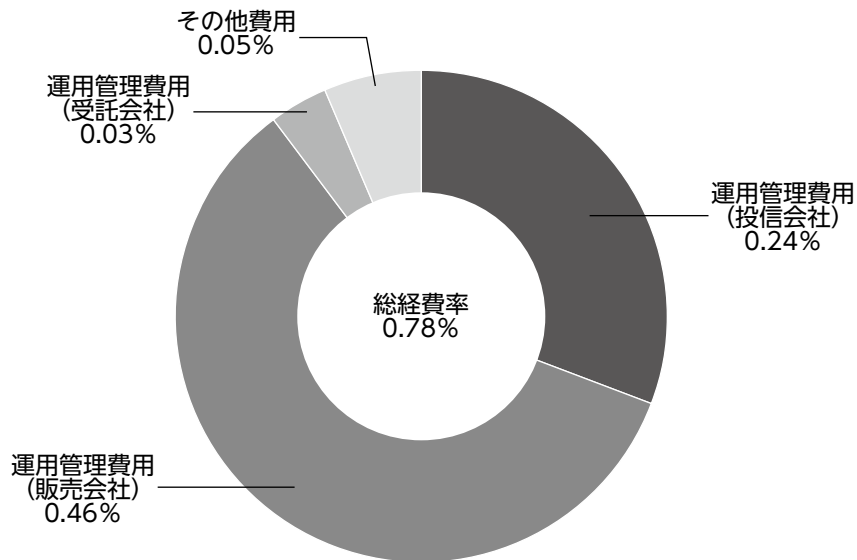
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## <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)実質的に投資対象とする円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
米国株式デイリートレンド戦略マザーファンド	千口 131	千円 117	千口 2,610,191	千円 2,342,365

### 利害関係人<sup>※</sup>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 0.352223	百万円 0.352223	% 100.0	百万円 0.352223	百万円 0.352223	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	9,073	876	9.7	9,086	881	9.7

(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。

### <米国株式デイリートレンド戦略マザーファンド>

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 0.205129	百万円 0.205129	% 100.0	百万円 0.205129	百万円 0.205129	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	6,706	700	10.4	6,734	705	10.5

<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。

### 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
米国株式デイリートレンド戦略マザーファンド	千口 4,905,913	千口 2,295,853	千円 2,069,941

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、2,295,853千口です。

※ 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
米国株式デイリートレンド戦略マザーファンド	2,069,941	98.3
コール・ローン等、その他	34,951	1.7
投資信託財産総額	2,104,892	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 2024年3月11日現在
(A)資 産	2,104,892,624円
コール・ローン等	28,535,897
米国株式デイリートレンド 戦略マザーファンド(評価額)	2,069,941,621
未 収 入 金	6,415,106
(B)負 債	16,250,750
未 払 解 約 金	6,414,919
未 払 信 託 報 酬	9,763,022
未 払 利 息	12
そ の 他 未 払 費 用	72,797
(C)純 資 産 総 額(A-B)	2,088,641,874
元 本	2,372,006,895
次 期 繰 越 損 益 金	△283,365,021
(D)受 益 権 総 口 数	2,372,006,895口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,805円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年3月11日 至 2024年3月11日
(A)配 当 等 収 益	△9,965円
受 取 利 息	99
支 払 利 息	△10,064
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	16,695,292
売 買 益	15,915,315
売 買 損	779,977
(C)信 託 報 酬 等	△24,480,719
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△7,795,392
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△227,038,024
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△48,531,605
(配 当 等 相 当 額)	(△5,143)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△48,526,462)
(G) 計 (D+E+F)	△283,365,021
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△283,365,021
追 加 信 託 差 損 益 金	△48,531,605
(配 当 等 相 当 額)	(△5,143)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△48,526,462)
繰 越 損 益 金	△234,833,416

(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5,036,014,516円、期中追加設定元本額は434,430円、期中一部解約元本額は2,664,442,051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)		－円
(C)	収益調整金額		－円
(D)	分配準備積立金額		－円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		－円
(F)	期末残存口数		2,372,006,895口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		－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。

# 米国株式ダイリートレンド戦略マザーファンド

## 運用報告書

第4期（決算日 2024年3月11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2020年10月29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	主として米国株式ダイリートレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券を主要投資対象とします。
組入制限	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、金額の表記未滿は切捨て、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	期 騰 落 中 率	債 券 先 物 率	純 資 産 額
設定日 (2020年10月29日)	円 10,000	% —	% —	百万円 10,490
第1期 (2021年 3月10日)	9,328	△6.7	99.0	26,505
第2期 (2022年 3月10日)	8,003	△14.2	98.5	6,485
第3期 (2023年 3月10日)	8,982	12.2	99.6	4,406
第4期 (2024年 3月11日)	9,016	0.4	98.6	2,069

(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) 2023年 3月10日	円 8,982	% —	% 99.6	% —
3月末	8,905	△0.9	99.5	—
4月末	8,942	△0.4	99.0	—
5月末	8,994	0.1	99.9	—
6月末	9,003	0.2	99.5	—
7月末	8,951	△0.3	99.5	—
8月末	8,935	△0.5	98.1	—
9月末	8,954	△0.3	99.1	—
10月末	8,943	△0.4	99.1	—
11月末	8,995	0.1	99.0	—
12月末	8,991	0.1	99.2	—
2024年 1月末	8,974	△0.1	99.8	—
2月末	9,026	0.5	99.6	—
(当 期 末) 2024年 3月11日	9,016	0.4	98.6	—

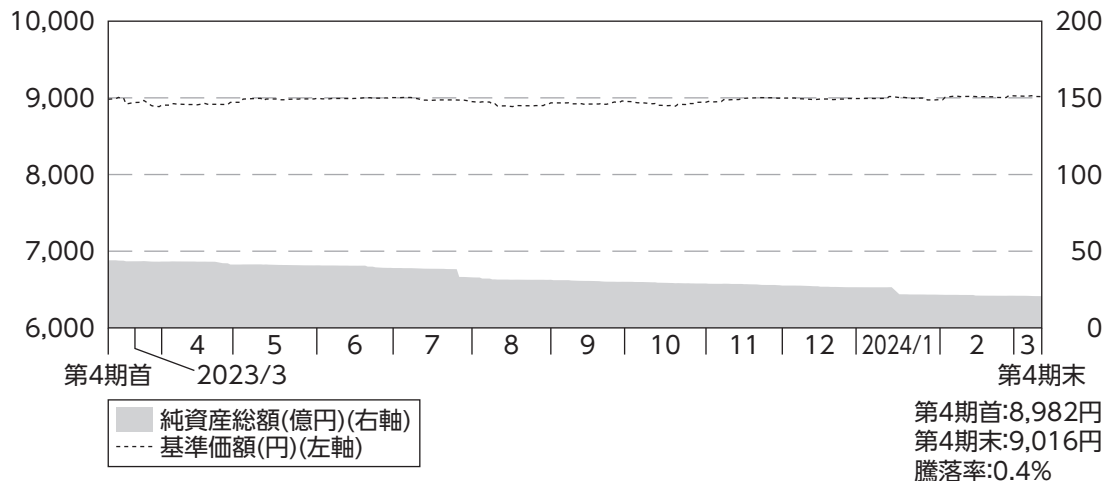
(注1) 騰落率は期首比です。

(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

当期の米国株式デイリートレンド戦略※のリターンがプラスとなったことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

※米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までには解消する戦略です。

## 投資環境

---

米国株式市場は、CPI(消費者物価指数)の伸びが鈍化したことでFRB(米連邦準備理事会)による利上げの休止が期待されたことや、米国景気の軟着陸期待の高まりなどから2023年7月にかけて上昇しましたが、その後は大手格付会社が米国債の格下げを発表したことや、FRBが政策金利を長期間高水準に維持するとの見方が強まったことなどから軟調に推移しました。11月以降は、労働需給の軟化、インフレ鈍化を示す指標を受けて長期金利が低下したことや、FRBによる早期の利下げ転換への期待が高まったことなどから上昇しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

---

主として米国株式デイリートレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指しました。



## 当ファンドの組入資産の内容

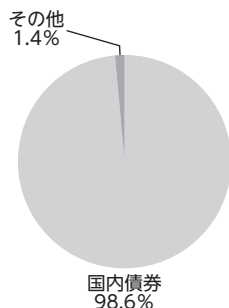
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 0% 11/06/24	アイルランド	98.6%
2	————	—	—
3	————	—	—
4	————	—	—
5	————	—	—
6	————	—	—

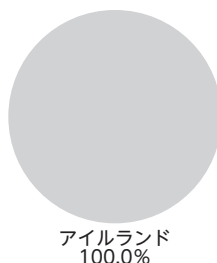
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	————	—	—
8	————	—	—
9	————	—	—
10	————	—	—
組入銘柄数		1	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

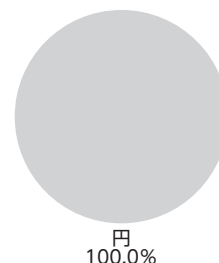
### ○資産別配分



### ○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おりません。

## 今後の運用方針

主として米国株式デイリートレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2023年3月11日~2024年3月11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)	4  (4)  (-) (-)	0.043  (0.043)  (-) (-)	(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	4	0.043	

(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(8,967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
国内	社債券（投資法人債券を含む）	千円 —	千円 2,357,731

(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<sup>\*</sup>との取引状況等

#### ■ 利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期 末		
	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	%
金 銭 信 託	0.205129	0.205129	100.0	0.205129	0.205129	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	6,706	700	10.4	6,734	705	10.5

(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。

### 組入資産の明細

#### <国内(邦貨建)公社債>

##### (A) 債券種類別開示

区 分	当 期				期 末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	千円 2,271,000 (2,271,000)	千円 2,040,266 (2,040,266)	% 98.6 (98.6)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 98.6 (98.6)
合 計	2,271,000 (2,271,000)	2,040,266 (2,040,266)	98.6 (98.6)	— (—)	— (—)	— (—)	98.6 (98.6)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2)( )内は非上場債で内書きです。

(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 名	当 期		期 末		償 還 年 月 日
	利 率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日	
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)					
STAR HELIOS 0%	11/06/24	2,271,000	2,040,266		2024/11/6
合 計		2,271,000	2,040,266		

※ 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
公 社 債	千円 2,040,266	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	36,106	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	2,076,372	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 2024年3月11日現在
(A)資 産	2,076,372,514円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	11,849,314
公 社 債(評価額)	2,040,266,400
未 収 入 金	24,256,800
(B)負 債	6,415,111
未 払 解 約 金	6,415,106
未 払 利 息	5
(C)純 資 産 総 額(A-B)	2,069,957,403
元 本	2,295,853,618
次 期 繰 越 損 益 金	△225,896,215
(D)受 益 権 総 口 数	2,295,853,618口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,016円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年3月11日 至 2024年3月11日
(A)配 当 等 収 益	△13,287円
受 取 利 息	109
支 払 利 息	△13,396
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	7,301,200
売 買 益	11,865,500
売 買 損	△4,564,300
(C)そ の 他 費 用	△1,363,352
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	5,924,561
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△499,632,842
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△13,748
(G)解 約 差 損 益 金	267,825,814
(H) 計 (D+E+F+G)	△225,896,215
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△225,896,215

- (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4,905,913,277円、期中追加設定元本額は131,401円、期中一部解約元本額は2,610,191,060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。

米国株式デイトリート戦略ファンド

2,295,853,618円

## お知らせ

該当事項はありません。