

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2024年12月16日(繰上償還決定前は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)

償還報告書(全体版)

第8期(償還日 2024年12月16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、投資信託約款の規定に
基づき、繰上償還いたしました。ここに謹んで設定以
来の運用状況と償還内容をご報告いたしますととも
に、受益者のみなさまのご愛顧に対しまして厚くお礼
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/>

償還金のお知らせ

1万口当たり償還金

11,697円42銭

- 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。
- 当償還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。)

【本償還報告書の記載について】

- ・基準(償還)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	債券先物率	純資産額
	(分配落)	税金 分配金	騰落 中率			
設定日(2017年10月16日)	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 0.5
第1期(2018年7月10日)	9,484	0	△5.2	96.3	—	263
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
第7期(2024年7月10日)	12,259	0	16.1	97.9	—	135
(償還日) 第8期(2024年12月16日)	(償還価額) 11,697.42	—	△4.6	—	—	72

(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		
(当期首) 2024年7月10日	円 12,259	% —	% 97.9	% —
7月末	12,044	△1.8	92.5	—
8月末	12,278	0.2	92.5	—
9月末	11,813	△3.6	93.1	—
10月末	11,727	△4.3	100.0	—
11月末	11,699	△4.6	96.7	—
(償還日) 2024年12月16日	(償還価額) 11,697.42	△4.6	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

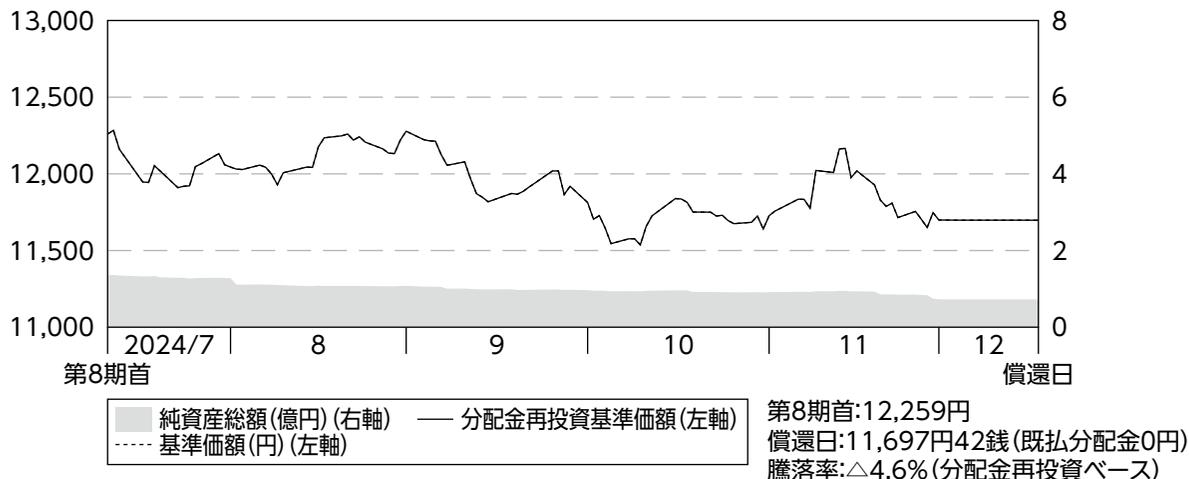
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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

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、2024年7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

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2024年9月のパフォーマンス不芳などから下落しました。

投資環境

当期の米国株式市場は上昇しました。

期初は、対中輸出規制の強化を検討との報道により半導体関連株への売りが広がったことや、軟調な雇用統計を受けた米国の景気後退懸念が広がったことなどから下落して始まりました。その後、FRB(米連邦準備理事会)が0.5%の大幅利下げを決定し、景気下支えを優先する姿勢を示したことで米国経済の軟着陸期待が高まったことなどから上昇に転じました。期末にかけては、トランプ次期政権による大規模減税継続や規制緩和への期待が高まり米国株式市場は堅調に推移しました。

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。なお、当ファンドの繰上償還に向けて、2024年11月末より「米国株式LSマザーファンド」を全て売却しました。

【「米国株式LSマザーファンド」の運用経過】

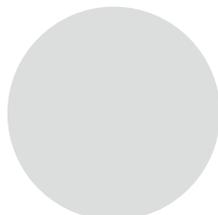
米ドル建債券の組入比率を高位に保つとともに、対円での為替ヘッジ(米ドル売り/円買い)を行い、米ドル/円の為替変動に伴うリスクの低減を図りました。米ドル建債券においては、Two Sigmaグループの運用会社が計量モデルを活用し、米国の金融商品取引所等に上場している株式等を対象にしたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行い、期を通じてロング・エクスポージャー、ショート・エクスポージャーともに米ドル建債券の時価総額比で120%程度から150%程度を維持しました。

当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

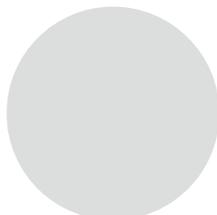
償還時における該当事項はありません。

○資産別配分



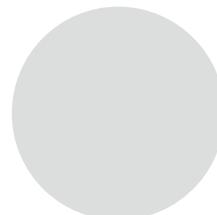
短期金融資産等
100.0%

○国別配分



日本
100.0%

○通貨別配分



円
100.0%

(注)比率は純資産総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

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。

分配金

該当事項はありません。

設定以来の運用経過

当ファンドの運用につきましては、「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」においては、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ました。

なお、当ファンドの繰上償還に向けて、2024年11月末より「米国株式LSマザーファンド」受益証券を全て売却しました。

【基準価額の主な変動要因】

<第1期>

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く銘柄選択やトレード等が期初比で軟調となったことが、基準価額の下落要因となりました。また、米ドル売り/円買いの為替ヘッジに伴うヘッジコストもマイナスに影響しました。

<第2期>

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く銘柄選択やトレード等が期初比で好調となったことが、基準価額の上昇要因となりました。一方、米ドル売り/円買いの為替ヘッジに伴うヘッジコストはマイナスに影響しました。

<第3期>

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く銘柄選択やトレード等が軟調となったことが、基準価額の下落要因となりました。また、米ドル売り/円買いの為替ヘッジに伴うヘッジコストもマイナスに影響しました。

<第4期>

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。クオリティを重視したポートフォリオであったことや市場構造の変化から2021年1月には大きくマイナスとなったことなどが、基準価額の下落要因となりました。また、米ドル売り/円買いの為替ヘッジに伴うヘッジコストもマイナスに影響しました。

<第5期>

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。期初はもみ合いで推移しましたが、2021年12月以降は銘柄選択やトレード等が奏功し始め、2022年1月から2月の市場混乱期は下振れを抑制しつつ、3月以降再び市場の落ち着きと共に着実にパフォーマンスを積み上げたことから、基準価額は上昇しました。

<第6期>

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。

<第7期>

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。2023年の9月から2024年の4月にかけて堅調に推移しました。

<第8期>

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2024年9月のパフォーマンス不芳などから下落しました。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2024年7月11日~2024年12月16日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	19円	0.163%	(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11,912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)	(10)	(0.086)	
(販売会社)	(7)	(0.062)	
(受託会社)	(2)	(0.014)	
(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	1	0.012	(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)	(1)	(0.009)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(—)	(—)	
合計	20	0.175	

(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。

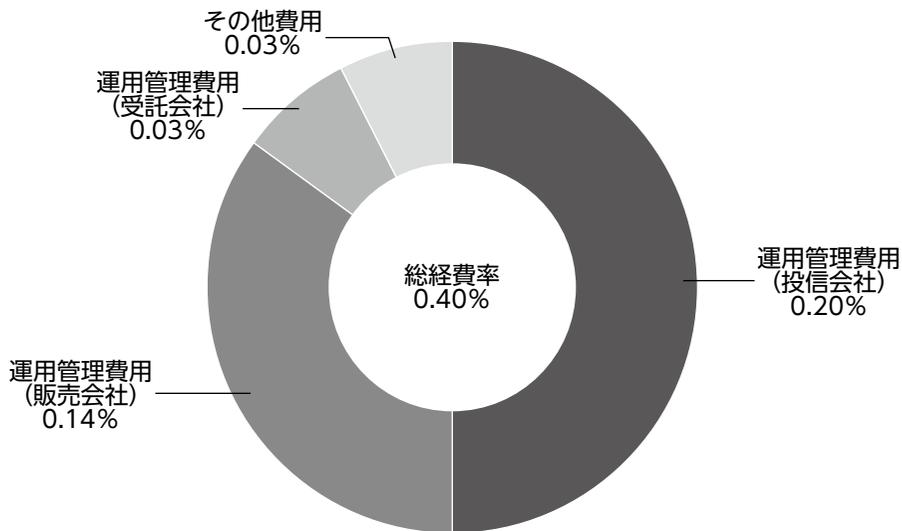
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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 —	千円 —	千口 107,000	千円 130,081

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 0.000952	百万円 0.000952	% 100.0	百万円 0.000952	百万円 0.000952	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	748	161	21.5	677	145	21.4

(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。

<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 81,728	百万円 81,728	% 100.0	百万円 76,192	百万円 76,192	% 100.0
為 替 直 物 取 引	—	—	—	4,807	4,807	100.0
金 銭 信 託	1	1	100.0	1	1	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	93,541	20,350	21.8	93,935	20,428	21.7

<平均保有割合 0.6%>

(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

償還時における該当事項はありません。

※ 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	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 72,718	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	72,718	100.0

資産、負債、元本および償還価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および償還価額の状況

項 目	償 還 時 2024年12月16日現在
(A)資 産	72,718,546円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	72,718,115
未 収 利 息	431
(B)負 債	165,713
未 払 信 託 報 酬	163,367
そ の 他 未 払 費 用	2,346
(C)純 資 産 総 額(A-B)	72,552,833
元 本	62,024,664
償 還 差 益 金	10,528,169
(D)受 益 権 総 口 数	62,024,664口
1万口当たり償還価額(C/D)	11,697円42銭

■損益の状況

項 目	当 期 自 2024年 7月11日 至 2024年12月16日
(A)配 当 等 収 益	6,285円
受 取 利 息	6,285
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△3,325,172
売 買 益	1,257,508
売 買 損	△4,582,680
(C)信 託 報 酬 等	△165,713
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△3,484,600
(E)前 期 繰 越 損 益 金	13,556,452
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	456,317
(配 当 等 相 当 額)	(2,096,389)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,640,072)
償 還 差 益 金(D+E+F)	10,528,169

(注1) (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。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は110,886,293円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は48,861,629円です。

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2017年10月16日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年12月16日		資 産 総 額	72,718,546円
区 分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負 債 総 額	165,713円
受益権口数	500,000口	62,024,664口	61,524,664口	純 資 産 総 額	72,552,833円
元 本 額	500,000円	62,024,664円	61,524,664円	受 益 権 口 数	62,024,664口
				1万口当たり償還金	11,697.42円
毎計算期末の状況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第 1 期	277,643,716円	263,306,261円	9,484円	0円	0.0000%
第 2 期	579,485,366	612,426,415	10,568	0	0.0000
第 3 期	823,131,452	822,048,603	9,987	0	0.0000
第 4 期	504,735,125	482,214,226	9,554	0	0.0000
第 5 期	520,301,564	533,009,539	10,244	0	0.0000
第 6 期	234,818,694	247,937,003	10,559	0	0.0000
第 7 期	110,886,293	135,938,165	12,259	0	0.0000

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7期（決算日 2024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	騰落率	債組入比率	債券先物率	純資産額
第3期(2020年7月10日)	円 10,113	% △5.1	% 96.8	% —	百万円 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
第7期(2024年7月10日)	12,617	16.3	98.6	—	20,065

(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 7月10日	円 10,849	% —	% 96.6	% —
7月末	10,934	0.8	95.9	—
8月末	10,832	△0.2	100.8	—
9月末	11,028	1.6	100.6	—
10月末	11,272	3.9	97.8	—
11月末	11,696	7.8	95.1	—
12月末	11,792	8.7	92.3	—
2024年 1月末	12,281	13.2	96.7	—
2月末	12,282	13.2	99.3	—
3月末	12,604	16.2	84.4	—
4月末	12,668	16.8	100.7	—
5月末	12,628	16.4	97.7	—
6月末	12,669	16.8	100.8	—
(当期末) 2024年 7月10日	12,617	16.3	98.6	—

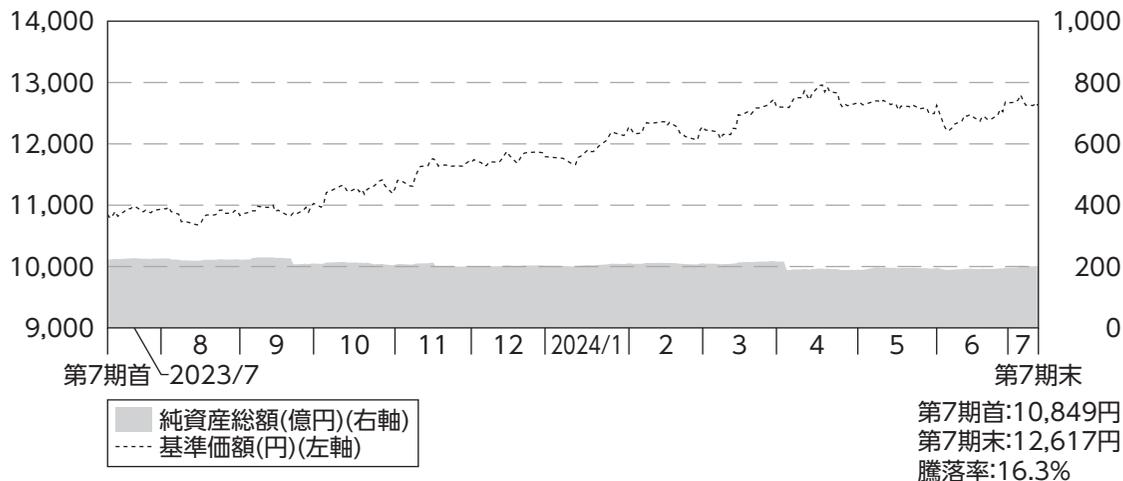
(注1) 騰落率は期首比です。

(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

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。2023年の9月から2024年の4月にかけて堅調に推移しました。

投資環境

当期の米国株式市場は上昇しました。期初から2023年10月にかけては、米経済の軟着陸期待が強まったことは好材料となりましたが、大手格付会社が米国債の格下げを発表したことや、FRB(米連邦準備理事会)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下落基調となりました。11月以降は、物価指標の伸びが鈍化したことで早期の利下げ転換期待が高まったことや、生成AI(人工知能)市場の成長期待を背景に半導体関連株が買われたことなどから期末にいたるまで堅調に上昇しました。

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、期を通してロング・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150%程度を維持しました。

当ファンドの組入資産の内容

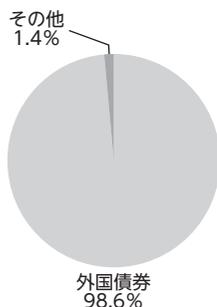
○上位10銘柄

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	98.6%
2	————	—	—
3	————	—	—
4	————	—	—
5	————	—	—
6	————	—	—

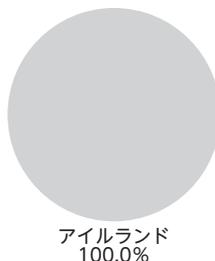
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	————	—	—
8	————	—	—
9	————	—	—
10	————	—	—
組入銘柄数		1	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

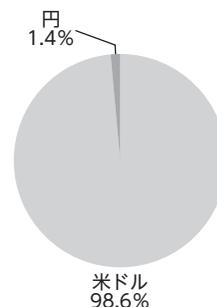
○資産別配分



○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
	(2023年7月11日~2024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)	0.023 (0.023) (-) (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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	3	0.023	

(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(11,890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 58,499

(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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為 替 先 物 取 引	244,105	244,105	100.0	238,598	238,598	100.0
為 替 直 物 取 引	-	-	-	8,772	8,772	100.0
金 銭 信 託	20	20	100.0	20	20	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	220,545	16,194	7.3	220,889	16,273	7.4

(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 80,000	千 米 ド ル 122,410	千 円 19,775,387	% 98.6	% —	% —	% 98.6	% —
合 計	80,000	122,410	19,775,387	98.6	—	—	98.6	—

(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
			当 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 80,000	千 米 ド ル 122,410	19,775,387	2027/10/18
合 計				19,775,387	

(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 19,775,387	% 95.3	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	976,203	4.7	
投 資 信 託 財 産 総 額	20,751,590	100.0	

(注1) 当期末における外貨建純資産(19,775,387千円)の投資信託財産総額(20,751,590千円)に対する比率は95.3%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=161.55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 2024年7月10日現在
(A)資 産	40,412,341,050円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	976,201,554
公 社 債(評価額)	19,775,387,196
未 収 入 金	19,660,750,500
未 収 利 息	1,800
(B)負 債	20,346,941,286
未 払 金	20,346,532,900
未 払 解 約 金	408,386
(C)純 資 産 総 額(A-B)	20,065,399,764
元 本	15,903,410,443
次 期 繰 越 損 益 金	4,161,989,321
(D)受 益 権 総 口 数	15,903,410,443口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,617円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年7月11日 至 2024年7月10日
(A)配 当 等 収 益	2,489,108円
受 取 利 息	2,709,620
支 払 利 息	△220,512
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	3,141,820,422
売 買 益	8,083,413,751
売 買 損	△4,941,593,329
(C)そ の 他 費 用	△4,724,797
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	3,139,584,733
(E)前 期 繰 越 損 益 金	1,757,494,730
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	320,658,765
(G)解 約 差 損 益 金	△1,055,748,907
(H)計 (D+E+F+G)	4,161,989,321
次 期 繰 越 損 益 金(H)	4,161,989,321

(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20,689,301,202円、期中追加設定元本額は1,469,520,237円、期中一部解約元本額は6,255,410,996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)	11,981,569,064円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,358,649,623円
コア投資戦略ファンド(安定型)	958,616,493円
コア投資戦略ファンド(切替型)	606,990,747円
FOFs用 米国株式LSファンドS(適格機関投資家専用)	309,332,106円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,116,183円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	247,342,593円
米国株式LSファンド(SMA専用)	107,000,577円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	66,793,057円

お知らせ

該当事項はありません。