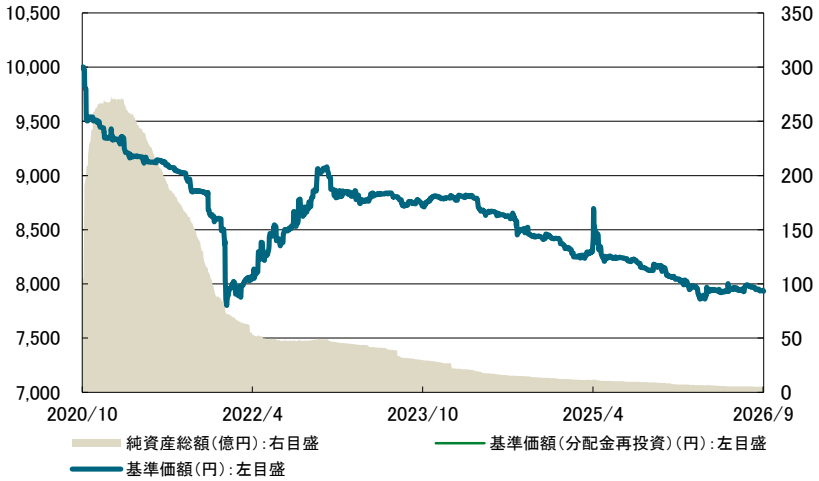
米国株式デイリートレンド戦略ファンド

追加型投信／海外／株式

当初設定日　：　2020年10月29日
作成基準日　：　2026年9月30日

基準価額の推移



※ データは、当初設定日から作成基準日までを表示しています。
※ 基準価額（分配金再投資）は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算しています。
※ 基準価額は、信託報酬控除後です。

基準価額、純資産総額

	当月末	前月末比
基準価額	7,932 円	－ 38 円
純資産総額	5.30 億円	－ 0.05 億円

期間別騰落率

	騰落率
1ヵ月	−0.48%
3ヵ月	−0.26%
6ヵ月	0.41%
1年	−2.40%
3年	−9.61%
設定来	−20.68%

※ ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算しています。

分配の推移（1万口当たり、税引前）

設定来分配金合計額　　0　円

決算期	2024年3月	2025年3月	2026年3月
分配金	0　円	0　円	0　円

※ 運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

資産内容

円建債券（仕組み債券）	99.68%
短期金融資産等	0.32%
合 計	100.00%

※ マザーファンドベースの数値です。
※ 対純資産総額比です。

＜本資料のお取扱いにおけるご留意点＞
●当資料は三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成したものであり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。
●ご購入のお申込みの際は最新の投資信託説明書（交付目論見書）の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。
●投資信託は値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクを伴います。）に投資しますので基準価額は変動します。したがって、投資元本や利回りが保証されるものではありません。ファンドの運用による損益は全て投資者の皆様に帰属します。
●投資信託は預貯金や保険契約とは異なり預金保険機構および保険契約者保護機構等の保護の対象ではありません。また、証券会社以外でご購入いただいた場合は、投資者保護基金の保護の対象ではありません。
●当資料は信頼できると判断した各種情報等に基づき作成していますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、今後予告なく変更される場合があります。
●当資料中の図表、数値、その他データについては、過去のデータに基づき作成したものであり、将来の成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、将来の市場環境の変動等により運用方針等が変更される場合があります。

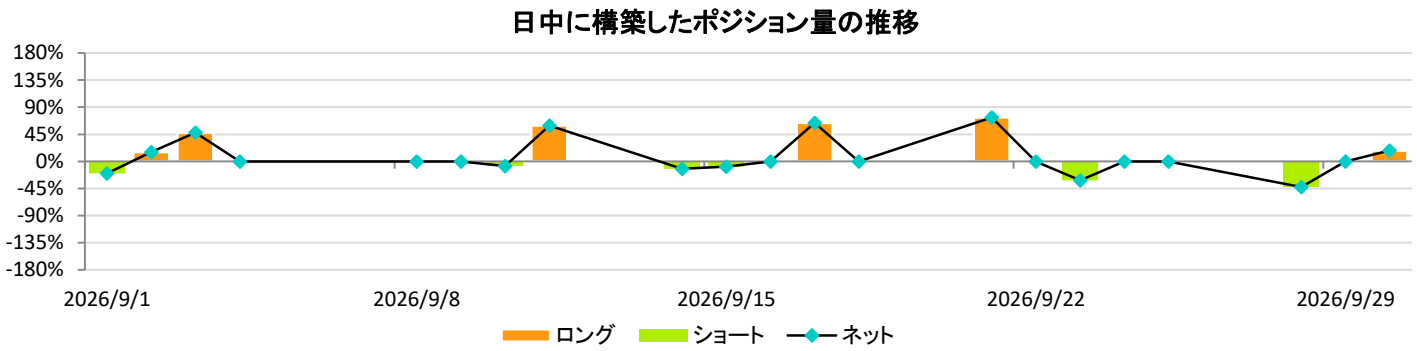
米国株式デイリートレンド戦略ファンド

追加型投信／海外／株式

当初設定日　：　2020年10月29日
作成基準日　：　2026年9月30日

※　下記はマザーファンドにおけるデイリートレンド戦略についての情報を掲載しています。

ご参考

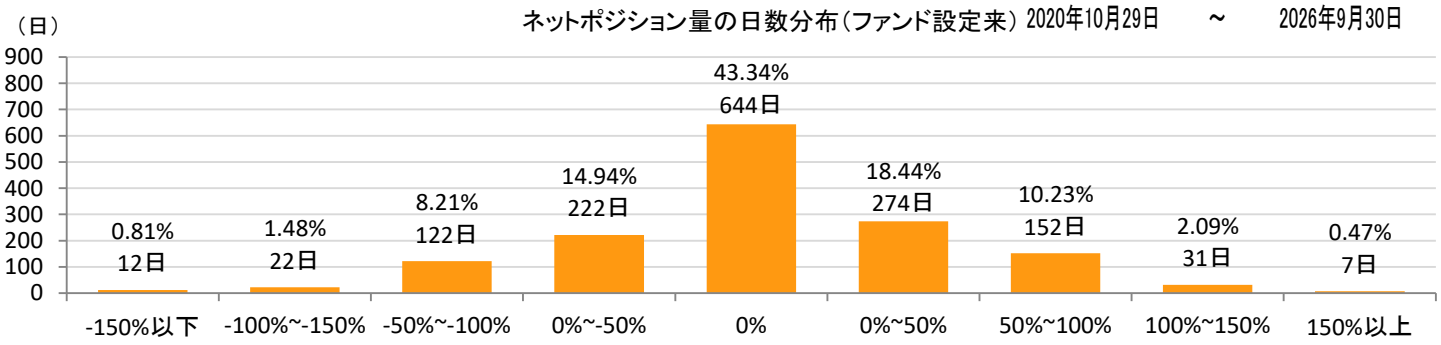


日次騰落率（%）

	9/1	9/2	9/3	9/4	9/8	9/9	9/10	9/11	9/14	9/15	9/16	9/17	9/18	9/21	9/22	9/23	9/24	9/25	9/28	9/29	9/30
当戦略	0.00	−0.02	−0.01	0.00	0.00	0.00	0.00	−0.11	−0.03	−0.01	0.00	0.03	0.00	0.13	0.00	0.00	0.00	0.00	0.02	0.00	−0.15
S&P500	−0.71	0.46	1.06	−0.38	−0.58	−0.48	−0.58	0.86	−0.48	−0.45	−0.45	1.14	0.17	1.49	0.00	−0.75	−0.02	0.51	−0.77	−0.17	−0.25

月次騰落率（%）

当戦略	−0.16	S&P500	−0.45



＊　当戦略のネットポジションは純投資割合（買い建てポジション－売り建てポジション）を日次ベースでレンジごとに集計したものです。

※　上記の当戦略データがファンドの基準価額へ反映するのには遅れが生じます。また、上記は計算上の値であること等から、ファンドのパフォーマンスとは完全には一致しません。

※　上記のグラフは、三井住友トラスト・アセットマネジメントがUBS証券からの情報提供に基づき作成しておりますが、掲載データに関する情報の正確性、信頼性、完全性を保証するものではありません。

ファンドマネージャーのコメント

【市場動向】
米国株式市場は下落しました。月前半は、米8月雇用統計が堅調であったことや、中東情勢の激化による原油価格上昇を背景としたインフレ懸念から、早期利上げに対する警戒感が高まり、下落しました。月後半は、米国とイランの交渉進展への期待から原油価格が下落したことやハイテク株の上昇により反発したものの、米長期金利の高止まりが株式市場の重石となり、月間では下落しました。

【運用実績】
全21営業日（海外）のうち、ポジションを全く取らなかった営業日が9営業日ありました。1、2、3、4回ポジションを取った営業日がそれぞれ3日、3日、2日、4日でした。4回ポジションを取った日のうち、プラスのリターンとなった営業日が3日、マイナスのリターンとなった営業日が1日ありました。

【今後の運用方針】
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の投資割合を高位に維持します。

米国株式デイリートレンド戦略ファンド

追加型投信／海外／株式

当初設定日　：　2020年10月29日
作成基準日　：　2026年9月30日

ファンドの特色

米国株式デイリートレンド戦略マザーファンドへの投資を通じて、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に投資し、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。

※ 当ファンドにおいて米国株式デイリートレンド戦略とは、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解消する戦略です。なお、株式市場の値動きによっては、同一日に買い建てポジションと売り建てポジションを同時に構築することや、買い建てポジションの合計額あるいは売り建てポジションの合計額が一時的に投資信託財産の純資産総額の2倍程度になることがあります。

投資リスク

《基準価額の変動要因》

- ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。
  従って、**投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。**
- **信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。**
- **投資信託は預貯金と異なります。**

【株価変動リスク】
ファンドが投資する債券は、株価指数等の変動に応じて価格が決定します。株価指数等の値動きが期待したものと異なった場合、基準価額の下落要因となります。

【金利変動リスク】
債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

【信用リスク】
有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

【流動性リスク】
時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

【ヘッジファンドの運用手法に係るリスク】
ヘッジファンドは、現物有価証券、デリバティブや為替予約取引等の買建てや売建てによりポートフォリオを組成することがあり、買い建てている対象が下落した場合もしくは売り建てている対象が上昇した場合に損失が発生し、ファンドの基準価額が影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。また、ヘッジファンドの純資産総額を上回る買建て、売建てを行う場合があるため、ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。

【仕組み債券に係るリスク】
仕組み債券の価格は、仕組み債券を通じて投資する実質的な投資対象の価格変動以外に、取引に関わる関係法人の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。仕組み債券の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。また、仕組み債券の取引に関わるブローカーは少数であることが多いため（1社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合がある他、取引自体に制約が生じることもあります。仕組み債券の取引に制約が生じた場合、ファンドの購入・換金のお申込みの受付を中止する場合があります。その他、ファンドが投資する仕組み債券の発行体は少数であることが多いため（1社の場合もあります）、発行体の信用リスクが顕在化した場合には、多数の発行体に分散投資を行うファンドと比較して、大きな影響を被る可能性があります。

※ 基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

《その他の留意点》

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
  分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
  投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。
  これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

米国株式デイリートレンド戦略ファンド

追加型投信／海外／株式

当初設定日　：　2020年10月29日
作成基準日　：　2026年9月30日

お申込みメモ

購入単位	販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
購入価額	購入申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。 （基準価額は1万口当たりで表示しています。）
換金単位	販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
換金価額	換金申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。（信託財産留保額の控除はありません。）
換金代金	原則として、換金申込受付日から起算して6営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として、販売会社の営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
購入・換金申込受付不可日	申込日当日又は申込日の翌営業日が次のいずれかの場合は、購入・換金のお申込みを受け付けないものとします。 ニューヨークの銀行休業日 ロンドンの銀行休業日
換金制限	ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
購入・換金申込受付の中止及び取消し	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた購入・換金のお申込みの取消しを行うことがあります。
信託期間	原則として、2020年10月29日（設定日）から2030年3月11日までとします。
繰上償還	次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了（繰上償還）させることができます。 ・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合 ・ファンドを償還することが受益者のために有利であると認める場合 ・やむを得ない事情が発生した場合
決算日	毎年3月10日（休業日の場合は翌営業日）です。
収益分配	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。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。 ファンドは、NISAの対象ではありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。 なお、配当控除あるいは益金不算入制度の適用はありません。

米国株式デイリートレンド戦略ファンド

追加型投信／海外／株式

当初設定日　：　2020年10月29日
作成基準日　：　2026年9月30日

ファンドの費用

《投資者が直接的に負担する費用》

■ 購入時手数料

購入申込受付日の翌々営業日の基準価額に**3.3%（税抜3.0%）を上限**として販売会社が定める率を乗じて得た額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

■ 信託財産留保額

ありません。

《投資者が信託財産で間接的に負担する費用》

■ 運用管理費用（信託報酬）

運用管理費用（信託報酬）の総額は、以下の通りです。

＜当ファンド＞

純資産総額に対して年率0.737%（税抜0.67%）を乗じて得た額

＜実質的に投資対象とする円建債券の発行・管理手数料等＞

円建債券の評価額に対して年率0.22%～0.5%程度（投資比率による加重平均）

＜実質的な負担＞

純資産総額に対して**年率0.957%～1.237%程度（税抜0.89%～1.17%程度）**

この値は目安であり、実質的に投資対象とする円建債券の実際の組入れ状況等により変動します。

■ その他の費用・手数料

有価証券の売買・保管、信託事務に係る諸費用等をその都度、監査費用等を日々、ファンドが負担します。この他、実質的に投資対象とする円建債券の価格には、上記費用とは別に、運営・運用等に要する諸費用等が含まれることがあります。これらの費用は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※ 上記の手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券等に投資することもありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※ 詳しくは投資信託説明書（交付目論見書）の「お申込みメモ」、「ファンドの費用・税金」をご覧ください。

米国株式デイリートレンド戦略ファンド

追加型投信／海外／株式

当初設定日　：　2020年10月29日
作成基準日　：　2026年9月30日

委託会社・その他の関係法人の概要

■ 委託会社　三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（ファンドの運用の指図を行う者）
金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第347号
加　入　協　会　：　一般社団法人資産運用業協会
ホームページ　：　https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル　：　0120-668001　受付時間 9:00～17:00 [土日・祝日等は除く]

■ 受託会社　三井住友信託銀行株式会社（ファンドの財産の保管及び管理を行う者）

SMTAM投信関連情報サービス
お客様が指定されたファンドに関する情報（基準価額、レポート）や投資に関するコラム等をLINEでお知らせします。
※LINEご利用設定は、お客様のご判断でお願いします。
※サービスのご利用にあたっては、あらかじめ「SMTAM投信関連情報サービス利用規約」をご確認ください。

販売会社

商号等		登録番号	加入協会			
			日本証券業協会	一般社団法人資産運用業協会	一般社団法人金融先物取引業協会	一般社団法人第二種金融商品取引業協会
株式会社三井住友銀行（委託金融商品取引業者 SMBC日興証券株式会社）	登録金融機関	関東財務局長（登金）第54号	○		○	○
SMBC日興証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第2251号	○	○	○	○

・お申込み、投資信託説明書（交付目論見書）のご請求は、販売会社へお申し出ください。
・販売会社は今後変更となる場合があります。