

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	令和1年6月11日
<b>【発行者名】</b>	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 松下 隆史
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都港区愛宕二丁目5番1号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	植松 克彦
<b>【電話番号】</b>	03-5405-0784
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】</b>	米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】</b>	1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当ありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

2019年3月15日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項のうち、有価証券報告書の提出等に伴う訂正事項がありますので、本訂正届出書を提出するものではありません。

**2【訂正箇所および訂正事項】**

## 第一部【証券情報】

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

## (2)内国投資信託受益証券の形態等

(以下略)

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友アセットマネジメント株式会社（2019年4月1日より、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社となります（予定）。以下、新会社名を記載します。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(以下略)

## (4)発行（売出）価格

(以下略)

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

(注)委託会社に対する照会先の情報は、2019年4月1日現在（予定）のものであります（以下同じ。）。  
お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

(以下略)

<訂正後>

## (2)内国投資信託受益証券の形態等

(以下略)

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友D Sアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(以下略)

## (4)発行（売出）価格

(以下略)

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

(以下略)

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1 ファンドの性格

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

#### (2) ファンドの沿革

(以下略)

2019年4月1日 ファンドの委託会社としての業務を大和住銀投信投資顧問株式会社から三井住友D Sアセットマネジメント株式会社へ承継(予定)

#### (3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況

- ・資本金の額 20億円(2019年4月1日現在(予定))
- ・会社の沿革 1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

(以下略)

2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更(予定)

- ・大株主の状況(2019年4月1日現在(予定))

(以下略)

<訂正後>

#### (2) ファンドの沿革

(以下略)

2019年4月1日 ファンドの委託会社としての業務を大和住銀投信投資顧問株式会社から三井住友D Sアセットマネジメント株式会社へ承継

#### (3) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況

- ・資本金の額 20億円(2019年4月1日現在)
- ・会社の沿革 1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

(以下略)

2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

- ・大株主の状況(2019年4月1日現在)

(以下略)

#### 2 投資方針

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

#### (3) 運用体制

(以下略)

委託会社によるファンドの関係法人(販売会社を除く)に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務(保管・管理・計算等)を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

上記の運用体制は、2019年4月1日現在(予定)のものです。

#### (4) 配分方針

(以下略)

<訂正後>

(3)運用体制

(以下略)

委託会社によるファンドの関係法人(販売会社を除く)に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務(保管・管理・計算等)を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

(4)分配方針

(以下略)

[次へ](#)

### 3 投資リスク

#### < リスクの管理体制 >

下線部は訂正部分を示します。

#### < 訂正前 >

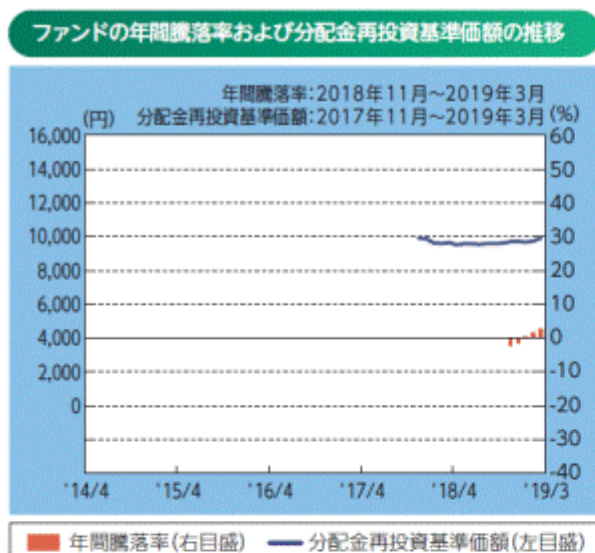
委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、リスク管理部において信託約款等に定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング等、コンプライアンス部において法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行っています。当該モニタリングおよび確認結果等は、運用評価会議、リスク管理会議およびコンプライアンス会議に報告されます。（2019年4月1日現在（予定））

#### < 訂正後 >

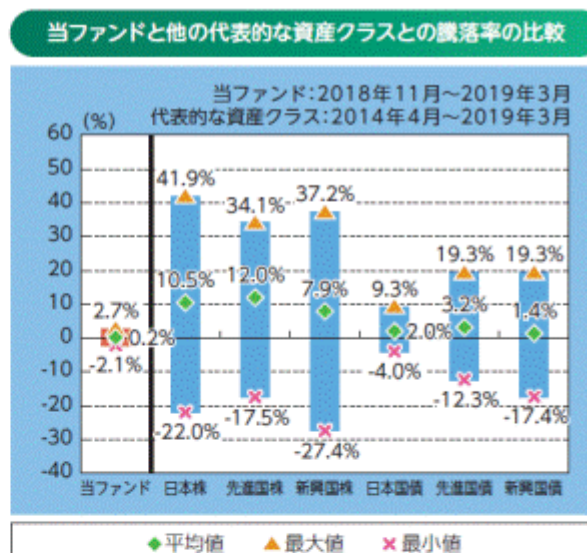
委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、リスク管理部において信託約款等に定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング等、コンプライアンス部において法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行っています。当該モニタリングおよび確認結果等は、運用評価会議、リスク管理会議およびコンプライアンス会議に報告されます。

#### < 参考情報 >

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。



- ※年間騰落率は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。
- ※年間騰落率および分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したもものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額とは異なる場合があります。



- ※上記グラフは、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものであり、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成しています。全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- ※ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したもものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- (注)上記グラフにおいて、当ファンドと代表的な資産クラスのデータの期間が異なりますので、ご注意ください。

#### < 各資産クラスの指数について >

資産クラス	指数名	権利者
日本株	TOPIX(配当込み)	株式会社東京証券取引所
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI国債	野村證券株式会社
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	FTSE Fixed Income LLC
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)	J.P.Morgan Securities LLC

(注) 上記指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利は、各権利者に帰属します。各権利者は、当ファンドの運用に関して一切の責任を負いません。

[次へ](#)

#### 4 手数料等及び税金

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

##### (3) 信託報酬等

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.4536%（税抜0.42%）を乗じて得た金額とします。委託会社は販売会社に対して、販売会社の行う業務に対する代行手数料を支払います。委託会社、販売会社および受託会社の間の配分は以下の表のとおりです。

（以下略）

上記の委託会社、販売会社および受託会社の間の信託報酬の配分はそれぞれ「ファンドの運用等の対価」、「購入後の情報提供、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等の対価」および「運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価」です。

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

（以下略）

##### (4) その他の手数料等

（以下略）

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年率0.0108%（税抜0.0100%）以内の率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了時に信託財産中から支弁します。また、委託会社は信託財産の規模等を考慮してその率または金額を変更することができます。

信託財産留保額はありませぬ。

##### (5) 課税上の取扱い

（以下略）

\* 上記の内容は2018年10月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

（以下略）

< 訂正後 >

##### (3) 信託報酬等

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.4536%<sup>\*</sup>（税抜0.42%）を乗じて得た金額とします。委託会社は販売会社に対して、販売会社の行う業務に対する代行手数料を支払います。委託会社、販売会社および受託会社の間の配分は以下の表のとおりです。

（以下略）

上記の委託会社、販売会社および受託会社の間の信託報酬の配分はそれぞれ「ファンドの運用等の対価」、「購入後の情報提供、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等の対価」および「運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価」です。

\* 消費税率が10%になった場合は、年率0.462%となります。

信託報酬は日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

（以下略）

##### (4) その他の手数料等

（以下略）

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年率0.0108%<sup>\*</sup>（税抜0.0100%）以内の率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了時に信託財

産中から支弁します。また、委託会社は信託財産の規模等を考慮してその率または金額を変更することができません。

\*消費税率が10%になった場合は、年率0.0110%となります。

信託財産留保額はありませぬ。

(5)課税上の取扱い

(以下略)

\*上記の内容は2019年3月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

[前へ](#) [次へ](#)



## 5 運用状況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

## (1) 投資状況

（2019年3月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （米国中期債運用戦略マザーファンド）	日本	2,780,360,757	100.20%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,571,800	0.20%
純資産総額		2,774,788,957	100.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（2019年3月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円)	評価単価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
	国・地域			簿価(円)	時価(円)		
1	米国中期債運用戦略マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,784,816,464	0.9866	0.9984	-	100.20%
				2,747,709,973	2,780,360,757	-	

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
親投資信託受益証券	100.20%
合計	100.20%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（2019年3月末現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（2019年3月末現在）

該当事項はありません。

## (3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （2017年11月7日）	3,245	-	1.0000	-
第1計算期間末 （2018年3月12日）	3,610	-	0.9603	-
2018年3月末日	3,620	-	0.9655	-
2018年4月末日	3,519	-	0.9513	-
2018年5月末日	3,189	-	0.9590	-
2018年6月末日	3,101	-	0.9585	-
2018年7月末日	2,971	-	0.9539	-
2018年8月末日	2,785	-	0.9597	-
第2計算期間末 （2018年9月11日）	2,131	-	0.9579	-
2018年9月末日	2,059	-	0.9599	-
2018年10月末日	1,773	-	0.9613	-
2018年11月末日	1,929	-	0.9699	-
2018年12月末日	1,809	-	0.9724	-
2019年1月末日	1,836	-	0.9669	-
2019年2月末日	2,345	-	0.9739	-
第3計算期間末 （2019年3月11日）	2,357	-	0.9790	-
2019年3月末日	2,774	-	0.9919	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

分配の推移

該当事項はありません。

#### 収益率の推移

期間	収益率
第1期（2017年11月7日～2018年3月12日）	4.0%
第2期（2018年3月13日～2018年9月11日）	0.2%
第3期（2018年9月12日～2019年3月11日）	2.2%

（注）収益率 = （当計算期末分配付基準価額 - 前計算期末分配付基準価額） ÷ 前計算期末分配付基準価額 × 100

#### （4）設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1期（2017年11月7日～2018年3月12日）	4,020,382,237	261,000,000
第2期（2018年3月13日～2018年9月11日）	104,441,878	1,638,347,723
第3期（2018年9月12日～2019年3月11日）	720,361,532	537,674,415

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### （参考）マザーファンドの運用状況

##### 米国中期債運用戦略マザーファンド

#### （1）投資状況

（2019年3月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
国債証券	アメリカ	4,767,080,257	100.03%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,640,080	0.03%
純資産総額		4,765,440,177	100.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### （2）投資資産

##### 投資有価証券の主要銘柄

（2019年3月末現在）

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券 -	10,700,000	11,276.54 1,206,590,114	11,411.10 1,220,988,115	2.7500 2025/08/31	25.62%
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券 -	10,520,000	11,099.99 1,167,719,774	11,248.05 1,183,295,866	2.5000 2026/02/28	24.83%
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券 -	10,360,000	11,273.98 1,167,984,707	11,404.22 1,181,477,451	2.7500 2025/02/28	24.79%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券 -	10,840,000	10,777.09 1,168,237,620	10,897.77 1,181,318,824	1.8750 2024/08/31	24.79%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
国債証券	100.03%
合計	100.03%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

（2019年3月末現在）

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

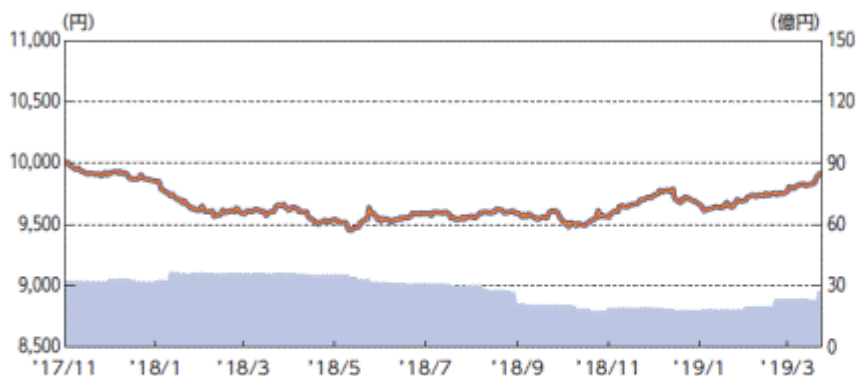
（2019年3月末現在）

該当事項はありません。

#### （参考情報）

2019年3月29日現在

## 基準価額・純資産の推移 (設定日～2019年3月29日)



■ 純資産総額: 右目盛

■ 基準価額: 左目盛

■ 分配金再投資基準価額: 左目盛

\* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。

## 分配の推移

2019年3月	0円
2018年9月	0円
2018年3月	0円
設定来累計	0円

\* 分配金は1万口当たり、税引前

## 主要な資産の状況

投資銘柄	投資比率
米国中期債運用戦略マザーファンド	100.2%

## ■ 参考情報

米国中期債運用戦略マザーファンド

上位10銘柄

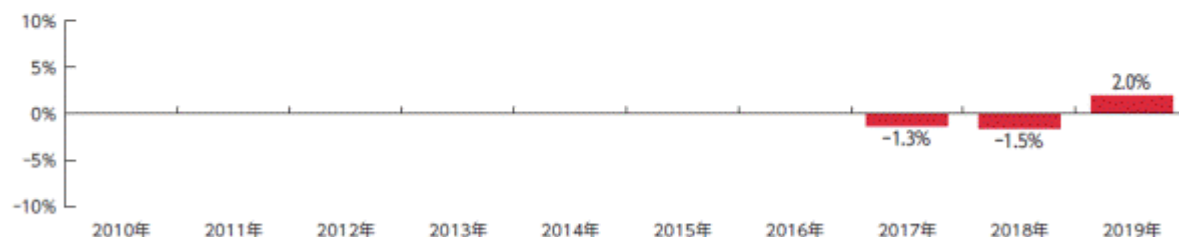
	投資銘柄	種別	投資比率
1	US TREASURY N/B 2.75 08/31/25	国債証券	25.6%
2	US TREASURY N/B 2.5 02/28/26	国債証券	24.8%
3	US TREASURY N/B 2.75 02/28/25	国債証券	24.8%
4	US TREASURY N/B 1.875 08/31/24	国債証券	24.8%

## 債券種別構成

種別	投資比率
国債証券	100.0%

\* 投資比率は全て純資産総額対比

## 年間収益率の推移



\* ファンドの収益率は暦年ベースで表示しております。但し、2017年は当初設定日(2017年11月7日)から年末までの収益率、2019年は3月末までの収益率です。

\* ファンドの年間収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。

\* ファンドには、ベンチマークはありません。

- ・ ファンドの運用実績はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

[前へ](#)

## 第2【管理及び運営】

### 3 資産管理等の概要

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(5)その他

(以下略)

公告(2019年4月1日現在(予定))

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

(以下略)

<訂正後>

(5)その他

(以下略)

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

(以下略)

## 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載されている金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(平成30年9月12日から平成31年3月11日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

[次へ](#)

## 1 財務諸表

## 米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

## (1) 貸借対照表

区分	第2期 平成30年9月11日現在 金額（円）	第3期 平成31年3月11日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	2,139,240,382	2,362,159,693
流動資産合計	2,139,240,382	2,362,159,693
資産合計	2,139,240,382	2,362,159,693
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	348,851	208,455
未払委託者報酬	6,978,142	4,170,015
その他未払費用	174,359	104,154
流動負債合計	7,501,352	4,482,624
負債合計	7,501,352	4,482,624
純資産の部		
元本等		
元本	2,225,476,392	2,408,163,509
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	93,737,362	50,486,440
（分配準備積立金）	23,694,753	39,405,297
元本等合計	2,131,739,030	2,357,677,069
純資産合計	2,131,739,030	2,357,677,069
負債純資産合計	2,139,240,382	2,362,159,693

## (2) 損益及び剰余金計算書

区分	第2期 自 平成30年3月13日 至 平成30年9月11日 金額（円）	第3期 自 平成30年9月12日 至 平成31年3月11日 金額（円）
営業収益		
有価証券売買等損益	2,151,137	47,968,366
営業収益合計	2,151,137	47,968,366
営業費用		
受託者報酬	348,851	208,455
委託者報酬	6,978,142	4,170,015
その他費用	174,359	104,154
営業費用合計	7,501,352	4,482,624
営業利益又は営業損失（ ）	9,652,489	43,485,742
経常利益又は経常損失（ ）	9,652,489	43,485,742
当期純利益又は当期純損失（ ）	9,652,489	43,485,742

一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	4,477,518	579,268
期首剰余金又は期首欠損金( )	149,069,347	93,737,362
剰余金増加額又は欠損金減少額	65,135,620	22,665,965
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	65,135,620	22,665,965
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,628,664	22,321,517
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,628,664	22,321,517
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	93,737,362	50,486,440

[次へ](#)

## (3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第3期	
	自 平成30年 9月12日	至 平成31年 3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第2期		第3期	
	平成30年 9月11日現在		平成31年 3月11日現在	
1. 元本状況				
期首元本額		3,759,382,237円		2,225,476,392円
期中追加設定元本額		104,441,878円		720,361,532円
期中一部解約元本額		1,638,347,723円		537,674,415円
2. 受益権の総数		2,225,476,392口		2,408,163,509口
3. 元本の欠損		93,737,362円		50,486,440円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第2期		第3期	
	自 平成30年 3月13日	至 平成30年 9月11日	自 平成30年 9月12日	至 平成31年 3月11日
分配金の計算過程 該当事項はありません。				分配金の計算過程 該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第3期	
	自 平成30年 9月12日	至 平成31年 3月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、リスク管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	
	平成31年 3月11日現在	
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	

2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
------------	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（平成30年9月11日現在）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	245,891
合計	245,891

第3期（平成31年3月11日現在）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	47,113,851
合計	47,113,851

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第2期（平成30年9月11日現在）

該当事項はありません。

第3期（平成31年3月11日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期（自平成30年9月12日 至 平成31年3月11日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第2期 平成30年9月11日現在	第3期 平成31年3月11日現在
1口当たり純資産額 0.9579円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,579円）」	1口当たり純資産額 0.9790円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,790円）」

（4）附属明細表

有価証券明細表

< 株式以外の有価証券 >

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	親投資信託 受益証券	米国中期債運用戦略マザーファ ンド	2,397,644,837	2,362,159,693	
	合計	1銘柄	2,397,644,837	2,362,159,693	

[前へ](#) [次へ](#)



## &lt;参考&gt;

当ファンドは、「米国中期債運用戦略マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 米国中期債運用戦略マザーファンド

## (1) 貸借対照表

区分	第2期 平成30年9月11日現在 金額（円）	第3期 平成31年3月11日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	31,939,143	19,274,246
国債証券	3,983,818,739	4,311,262,525
派生商品評価勘定	5,273,707	794,247
未収入金	61,203,971	-
未収利息	2,427,883	2,664,673
前払費用	542,280	533,420
流動資産合計	4,085,205,723	4,334,529,111
資産合計	4,085,205,723	4,334,529,111
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,215,254	936,505
その他未払費用	108	-
流動負債合計	9,215,362	936,505
負債合計	9,215,362	936,505
純資産の部		
元本等		
元本	4,238,518,530	4,398,712,301
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	162,528,169	65,119,695
元本等合計	4,075,990,361	4,333,592,606
純資産合計	4,075,990,361	4,333,592,606
負債純資産合計	4,085,205,723	4,334,529,111

[前へ](#)   [次へ](#)

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第3期	
	自 平成30年9月12日	至 平成31年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。	
3. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益約定日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。	

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期		第3期	
	平成30年9月11日現在		平成31年3月11日現在	
1. 元本状況				
期首元本額		5,779,464,661円		4,238,518,530円
期中追加設定元本額		104,095,507円		716,248,784円
期中一部解約元本額		1,645,041,638円		556,055,013円
元本の内訳				
米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）		2,224,436,293円		2,397,644,837円
米国中期債運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）		2,014,082,237円		2,001,067,464円
合計		4,238,518,530円		4,398,712,301円
2. 受益権の総数		4,238,518,530口		4,398,712,301口
3. 元本の欠損		162,528,169円		65,119,695円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第3期	
	自 平成30年9月12日	至 平成31年3月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、リスク管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 平成31年3月11日現在	
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第2期（平成30年9月11日現在）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	8,693,501
合計	8,693,501

第3期（平成31年3月11日現在）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	76,644,879
合計	76,644,879

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(通貨関連)

区分	種類	第2期 平成30年9月11日現在			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	1,776,987,740	-	1,782,073,100	5,085,360
	売建 アメリカ・ドル	4,025,425,000	-	4,034,451,907	9,026,907
合計		-	-	5,816,525,007	3,941,547

区分	種類	第3期 平成31年3月11日現在			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	150,803,370	-	150,674,400	128,970
	売建 アメリカ・ドル	2,689,081,592	-	2,689,094,880	13,288
合計		-	-	2,839,769,280	142,258

(注)時価の算定方法

A. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合には、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

B. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

第3期(自平成30年9月12日 至 平成31年3月11日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第2期 平成30年9月11日現在	第3期 平成31年3月11日現在
1口当たり純資産額 0.9617円 「1口 = 1円(10,000口 = 9,617円)」	1口当たり純資産額 0.9852円 「1口 = 1円(10,000口 = 9,852円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

&lt;株式以外の有価証券&gt;

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ ・ドル	国債証券	T 1.875 08/31/24	9,940,000.000	9,640,209.600	
	国債証券	T 2.5 02/28/26	9,890,000.000	9,879,121.000	
	国債証券	T 2.75 02/28/25	9,560,000.000	9,700,340.800	
	国債証券	T 2.75 08/31/25	9,500,000.000	9,638,035.000	
	小計(アメリカ・ドル) 4銘柄			38,890,000.000	38,857,706.400 (4,311,262,525)
合計				4,311,262,525 (4,311,262,525)	

- (注) 1. 各種通貨ごとの小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。  
 2. 合計欄は邦貨金額を表示しております。( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。  
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 4銘柄	99.48%	100.00%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)で記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況  
純資産額計算書  
(2019年3月末現在)

米国中期債運用戦略ファンド(ダイワ投資一任専用)

資産総額	2,780,360,757	円
負債総額	5,571,800	円
純資産総額( - )	2,774,788,957	円
発行済数量	2,797,356,882	口
1単位当り純資産額( / )	0.9919	円

(参考)米国中期債運用戦略マザーファンド

資産総額	4,823,824,569	円
負債総額	58,384,392	円
純資産総額( - )	4,765,440,177	円
発行済数量	4,773,210,028	口
1単位当り純資産額( / )	0.9984	円

[前へ](#)

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1 委託会社等の概況

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

（2019年4月1日現在（予定））

（以下略）

< 訂正後 >

（2019年4月1日現在）

（以下略）

##### 2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

委託会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更しました。

2019年3月29日現在における三井住友アセットマネジメント株式会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(円)
追加型株式投資信託	467	5,759,755,732,324
単位型株式投資信託	92	523,512,840,677
追加型公社債投資信託	1	28,812,487,686
単位型公社債投資信託	115	311,786,512,725
合計	675	6,623,867,573,412

（ご参考）

2019年3月29日現在における大和住銀投信投資顧問株式会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(円)
追加型株式投資信託	309	2,926,233,606,958
単位型株式投資信託	21	57,872,142,748
追加型公社債投資信託	-	-
単位型公社債投資信託	72	250,140,415,808

合 計	402	3,234,246,165,514
-----	-----	-------------------

### 3 委託会社等の経理状況

下線部は訂正部分を示します。

#### < 訂正前 >

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

(以下略)

#### < 訂正後 >

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更しました。

(以下略)

### 5 その他

下線部は訂正部分を示します。

#### < 訂正前 >

##### イ 定款の変更、その他の重要事項

###### (イ) 定款の変更

(以下略)

b. 2019年4月1日付で、取締役の員数の上限を変更する等の定款の変更を行う予定です。

###### (ロ) その他の重要事項

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

(以下略)

#### < 訂正後 >

##### イ 定款の変更、その他の重要事項

###### (イ) 定款の変更

(以下略)

b. 2019年4月1日付で、取締役の員数の上限を変更する等の定款の変更を行いました。

###### (ロ) その他の重要事項

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更しました。

(以下略)

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1 名称、資本金の額及び事業の内容

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

## (1) 受託会社

名称	資本金の額(百万円) 2018年3月末現在	事業の内容

(以下略)

<参考:再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)の概要>

・資本金:51,000百万円(2018年3月末現在)

(以下略)

## (2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) 2018年3月末現在	事業の内容

(以下略)

<訂正後>

## (1) 受託会社

名称	資本金の額(百万円) 2018年9月末現在	事業の内容

(以下略)

<参考:再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)の概要>

・資本金:51,000百万円(2018年9月末現在)

(以下略)

## (2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) 2018年9月末現在	事業の内容

(以下略)

## 3 資本関係

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(持株比率5%以上を記載しています。)

該当事項はありません。(2019年4月1日現在(予定))

<訂正後>

(持株比率5%以上を記載しています。)

該当事項はありません。

以上



## 独立監査人の監査報告書

平成31年4月19日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）の平成30年9月12日から平成31年3月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）の平成31年3月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。