

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年6月26日提出
【計算期間】	第4期(自 2023年3月16日至 2024年3月15日)
【ファンド名】	シティグループ社債ノ円建て償還時ターゲットファンド2020-03
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	竹本 政司
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-0265
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券報告書の訂正報告書の提出理由】

2024年6月12日付をもって提出しました有価証券報告書(以下「原報告書」といいます。)について、「第一部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (1) 投資方針」において、委託会社と委託会社に対して助言を行う会社(以下「助言会社」といいます。)の資本関係の記載に誤りがございました。委託会社と当該助言会社は、2023年9月29日に資本関係の異動がありましたが、当該異動により記載内容に影響のあるファンドを抽出した際に当ファンドが抽出から漏れ、原報告書の作成・確認時においてもこれを看過しました。これを訂正するため本訂正報告書を提出いたします。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示しています。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<訂正前>

ファンドの特色

(略)

先進国マルチアセットAI運用戦略VT3指数について

- VT3指数は、日本を含む先進国の株価指数先物と債券先物等で構成されます。
- VT3指数は、AI(人工知能)を用いて各資産間の相対パフォーマンス予測から最適化した資産配分に基づき、ポートフォリオの目標リスク水準が年3%程度となることを目指して、シティグループが機械的に算出します。
- 目標リスク水準が年3%程度となるよう日次で組入比率の合計値を調整し、組入資産等の見直しは原則として月次で行います。
- VT3指数の基礎となる資産配分比率は、日興グローバルラップ*の助言を基に委託会社が提供します。
*日興グローバルラップは委託会社の子会社です(100%出資)。

(略)

<訂正後>

ファンドの特色

(略)

先進国マルチアセットAI運用戦略VT3指数について

- VT3指数は、日本を含む先進国の株価指数先物と債券先物等で構成されます。
- VT3指数は、AI(人工知能)を用いて各資産間の相対パフォーマンス予測から最適化した資産配分に基づき、ポートフォリオの目標リスク水準が年3%程度となることを目指して、シティグループが機械的に算出します。
- 目標リスク水準が年3%程度となるよう日次で組入比率の合計値を調整し、組入資産等の見直しは原則として月次で行います。
- VT3指数の基礎となる資産配分比率は、日興グローバルラップ*の助言を基に委託会社が提供します。
*日興グローバルラップは、委託会社の親会社である株式会社三井住友フィナンシャルグループの子会社(100%出資)です。

(略)