

【表紙】

【提出書類】	臨時報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年9月5日提出
【ファンド名】	データ戦略分散ファンド
【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【提出理由】

「データ戦略分散ファンド」につき、繰上償還にかかる手続きを開始することを決定しましたので、金融商品取引法第24条の5第4項および特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令第29条第2項第14号の規定に基づき、本臨時報告書を提出するものです。

2【報告内容】

(イ) 繰上償還の年月日

2024年12月4日（予定）

法令および信託約款の規定に基づく繰上償還手続きにおいて、書面決議により可決されることを条件として繰上償還するものとします。

(ロ) 繰上償還にかかる決定に至った理由

当ファンドおよび当ファンドの主要投資対象である「データ戦略分散マザーファンド」は2020年12月17日に設定され、運用の基本方針に基づき日本および米国の株式、債券、金に分散投資するために、株式会社NTTドコモおよびその関連会社等が提供する「独自性の高いオルタナティブ・データ等」を活用してポートフォリオを構築することにより、安定的な信託の成長を目指してまいりました。

しかしながら基準価額の下落傾向が継続したため、より安定的な運用を目指すべく、2023年5月9日に信託約款の運用の基本方針に関する変更を実施しました。その後は、基準価額の下落傾向を脱したものの回復には至っておりません。そのため、「独自性の高いオルタナティブ・データ等」の活用方法の見直しや使用データの変更等による更なる運用の改善について検討を行いましたが、当ファンドの商品性を維持した上でパフォーマンスを改善することは難しいと判断するにいたりました。

また、当ファンドは信託約款の繰上償還規定の「受益権の口数が30億口を下回る」状態が継続しております。

そのため、このまま運用を継続するより、運用を終了させ、お預かりした資産をお返しすることが受益者の皆さまにとって有利であると判断し、信託約款の規定に従い繰上償還の手続きを開始することを決定しました。

(ハ) 繰上償還にかかる情報の受益者への提供

2024年9月9日現在の受益者を対象に書面決議を行うため、当ファンドの信託契約にかかる知っている受益者に対して、繰上償還にかかる情報を記載した書面を交付いたします。

以上