

**【表紙】**

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 【提出書類】     | 臨時報告書                 |
| 【提出先】      | 関東財務局長殿               |
| 【提出日】      | 2025年2月18日提出          |
| 【ファンド名】    | 日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）  |
| 【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】

「日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）」（以下、「当ファンド」といいます。）につき、ファンド等の財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況に著しい影響を与える事象が発生しましたので、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12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) 当該事象の発生年月日

2025年2月14日

## (ロ) 当該事象の内容

当ファンドが主要投資対象とする外国投資信託証券「ジャパン・エクイティ・プレミアム・ファンドクラスA」（以下、「外国投資信託証券」といいます。）は、わが国の株式へ投資するとともに、スワップ取引を通じて、為替取引、株価指数オプション取引および通貨オプション取引の損益を享受します。

外国投資信託証券における当該スワップ取引の相手方は、2024年11月29日付でクレディ・スイス・インターナショナルからUBS AG ロンドン支店へ業務移管され、当該業務移管にあたりスワップ取引の決済が行われました。その際、外国投資信託証券の純資産価格算出会社が決済により発生した損失の計上を失念し、外国投資信託証券の純資産価格が本来の価格よりも高く算出されていたことが2025年2月13日に判明しました。また、2025年1月17日および2025年1月22日にも同様にスワップ取引決済による損失の計上漏れが発生していたことも判明しました。

これらを訂正するために、外国投資信託証券において2025年2月13日付で当該損失を計上したため、同日付の外国投資信託証券の純資産価格が下落しました。

## (ハ) 当該事象の損益に与える影響額

当ファンドの基準価額は、直近で知り得る外国投資信託証券の純資産価格をもとに計算するため、外国投資信託証券における2025年2月13日付の損失計上は、当ファンドの2025年2月14日の基準価額に反映されます。

|  |        |         |           |
|--|--------|---------|-----------|
| 2025年2月13日の基準価額<br>（外国投資信託証券における損失計上前） | 3,100円 |         |           |
| 2025年2月14日の基準価額<br>（外国投資信託証券における損失計上後） | 2,956円 | （ 144円） | （ 4.65%）  |
| 基準価額の変動額のうち、外国投資信託証券における損失計上分          |        | （ 146円） | （ 4.71%）  |
| 基準価額の変動額のうち、市場要因等                      |        | （ + 2円） | （ +0.06%） |

以上