

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和2年1月31日

【発行者名】 ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.
(Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg)
S.A.)

【代表者の役職氏名】 デュプティ・チーフ・エグゼクティブ・オフィサー 小林 央明

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、アーロン通り
287 - 289番
(287-289, Route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 大西 信治

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 大西 信治

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03(6212)8316

【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】
ニッセイ・ケイマン・トラスト
- J P X日経400ジャパン・ファンド
(Nissay Cayman Trust
- JPX Nikkei 400 Japan Fund)

【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券の金額】
米ドル建 米ドルヘッジクラス
30億アメリカ合衆国ドル(約3,287億円)を上限とする。
(注)アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)の円貨換算は、便宜上、
2019年11月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲
値(1米ドル=109.56円)による。

【縦覧に供する場所】 該当事項なし。

１【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、2019年10月31日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を下表のとおり新たな情報により更新および追加するため、また、その他の一部の情報の時点等を更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

２【訂正の内容】

(1) 半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容*と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第 1 ファンドの状況 5 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況 資産別および地域別の投資状況	更新
	(2) 投資資産		投資資産	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加または更新
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第 3 ファンドの経理状況 1 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 特別情報 第 1 管理会社の概況 1 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
2 事業の内容及び営業の概況			(2) 事業の内容及び営業の状況	更新

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです（5 管理会社の経理の概況は、訂正内容に該当しないため省略します。）。

[次へ](#)

１ ファンドの運用状況

ニッセイ・ケイマン・トラスト（以下「ファンド」という。）のサブ・ファンドであるＪＰＸ日経400
ジャパン・ファンド（以下「サブ・ファンド」という。）の運用状況は以下のとおりである。

（１）投資状況

資産別および地域別の投資状況

（2019年11月末日現在）

資産の種類	地域名	時価合計（米ドル）	投資比率（％）
株式	日本	35,293,610.35	96.83
現金・その他の資産 （負債控除後）		1,155,706.21	3.17
合計(純資産総額)		36,449,316.56 (約3,993百万円)	100.00

（注１）投資比率とは、サブ・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

（注２）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）の円貨換算は、便宜上、2019年11月29日現在の株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝109.56円）による。以下、特に記載がない限り、米ドルの円金額表示はすべてこれによる。

（注３）サブ・ファンドは、ケイマン諸島の法律に基づいて設定されているが、受益証券は、米ドル建のため以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルをもって行う。

（注４）本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入して記載してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入して記載してある。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

投資資産

() 投資有価証券の主要銘柄

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

(株式)

(2019年11月末日現在)

順位	銘柄	国名	業種	保有株数 (株)	取得価格 (米ドル)		時価 (米ドル)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
1	キーエンス	日本	電気機器	7,200	197.90	1,424,849.58	341.89	2,461,583.42	6.75
2	ビジョン	日本	その他製品	48,700	29.39	1,431,209.31	46.48	2,263,564.97	6.21
3	野村総合研究所	日本	情報・通信業	100,000	12.00	1,200,337.34	21.08	2,108,483.24	5.78
4	日本電産	日本	電気機器	13,700	88.51	1,212,540.53	147.84	2,025,413.20	5.56
5	塩野義製薬	日本	医薬品	34,200	42.06	1,438,510.10	58.79	2,010,588.99	5.52
6	バンダイナムコホールディングス	日本	その他製品	31,500	24.58	774,152.40	60.61	1,909,099.63	5.24
7	東京海上ホールディングス	日本	保険業	30,200	45.28	1,367,325.38	54.35	1,641,406.26	4.50
8	安川電機	日本	電気機器	43,000	13.39	575,834.83	36.71	1,578,485.98	4.33
9	東京エレクトロン	日本	電気機器	6,000	160.16	960,944.89	206.37	1,238,243.08	3.40
10	ファーストリテイリング	日本	小売業	2,000	487.58	975,169.75	608.99	1,217,970.96	3.34
11	リログループ	日本	サービス業	44,700	15.88	709,958.15	26.45	1,182,502.97	3.24
12	小糸製作所	日本	電気機器	21,300	39.56	842,693.26	51.50	1,096,995.71	3.01
13	日産化学	日本	化学	26,100	26.07	680,455.52	39.59	1,033,179.62	2.83
14	ベネフィット・ワン	日本	サービス業	47,000	10.27	482,887.84	21.80	1,024,463.52	2.81
15	クボタ	日本	機械	66,100	16.13	1,066,053.92	15.42	1,019,174.96	2.80
16	大塚商会	日本	情報・通信業	25,300	28.43	719,263.33	40.04	1,013,062.73	2.78
17	リクルートホールディングス	日本	サービス業	27,400	23.68	648,734.48	36.18	991,314.04	2.72
18	信越化学工業	日本	化学	8,200	107.88	884,581.28	106.93	876,833.17	2.41
19	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	165,200	7.24	1,195,280.38	5.28	872,085.84	2.39
20	ファナック	日本	電気機器	4,000	184.57	738,281.66	190.90	763,583.23	2.09
21	日野自動車	日本	輸送用機器	72,600	11.44	830,348.64	9.78	710,022.83	1.95
22	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	15,500	47.75	740,127.43	38.84	601,967.86	1.65
23	エス・エム・エス	日本	サービス業	21,100	10.61	223,781.87	27.07	571,093.05	1.57
24	三和ホールディングス	日本	金属製品	46,900	8.59	402,841.81	10.97	514,353.94	1.41
25	ユニ・チャーム	日本	化学	15,400	33.00	508,225.62	32.74	504,145.74	1.38
26	MonotaRO	日本	小売業	17,500	12.56	219,847.86	28.13	492,192.49	1.35
27	ダイキン工業	日本	機械	3,000	133.69	401,078.06	143.78	431,330.47	1.18
28	オーエスジー	日本	機械	20,600	19.83	408,441.76	20.39	420,051.14	1.15
29	ツルハホールディングス	日本	小売業	3,400	90.44	307,485.54	118.98	404,547.53	1.11
30	西日本旅客鉄道	日本	陸運業	4,500	74.76	336,403.66	88.00	396,004.93	1.09

- () 投資不動産物件
該当事項なし（2019年11月末日現在）。
- () その他投資資産の主要なもの
該当事項なし（2019年11月末日現在）。

(2) 運用実績

純資産の推移

2019年11月末日までの１年間における各月末の純資産の推移は以下のとおりである。

	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2018年12月末日	37,215,808.10	4,077,364	0.008815	0.9658
2019年１月末日	37,823,176.71	4,143,907	0.009137	1.0010
２月末日	38,612,555.77	4,230,392	0.009439	1.0341
３月末日	37,738,427.70	4,134,622	0.009495	1.0403
４月末日	38,929,200.59	4,265,083	0.009951	1.0902
５月末日	35,696,688.70	3,910,929	0.009124	0.9996
６月末日	36,758,548.39	4,027,267	0.009470	1.0375
７月末日	36,605,192.24	4,010,465	0.009599	1.0517
８月末日	34,999,163.68	3,834,508	0.009258	1.0143
９月末日	36,466,482.68	3,995,268	0.009858	1.0800
10月末日	37,650,837.09	4,125,026	0.010451	1.1450
11月末日	36,449,316.56	3,993,387	0.010514	1.1519

< 参考情報 >

純資産総額および1万口当たり純資産価格の推移



(注1) 課税前分配金再投資換算1万口当たり純資産価格は公表されている1万口当たり純資産価格に各収益分配金(課税前)をその分配を行う日に全額再投資したと仮定して算出したものであり、公表されている1万口当たり純資産価格とは異なります。以下同じです。

(注2) ベンチマークは参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。また、上記のグラフは、過去のベンチマークの推移に基づくものであり、将来におけるベンチマークの推移を示唆または保証するものではありません。さらに、ファンドの受益証券1万口当たり純資産価格は、必ずしもベンチマークに関連して推移するものではなく、ファンドの収益率がベンチマークの騰落率と関連することは保証されません。以下同じです。

分配の推移

2019年11月末日までの１年間の１口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

	１口当たり分配金	
	米ドル	円
2019年２月	0.0000	0.000000
2019年８月	0.0000	0.000000

< 参考情報 >

(2019年11月末日現在)
(単位:米ドル、1万口当たり課税前)

第1会計年度(2015年７月24日～2016年４月30日)	0.00
第2会計年度(2016年５月１日～2017年４月30日)	0.00
第3会計年度(2017年５月１日～2018年４月30日)	4.00
第4会計年度(2018年５月１日～2019年４月30日)	4.00
2019年２月	0.00
2019年８月	0.00
直近1年間累計	0.00
設定来累計	8.00

収益率の推移

計算期間	収益率（注）
2018年12月１日～2019年11月末日	5.22%

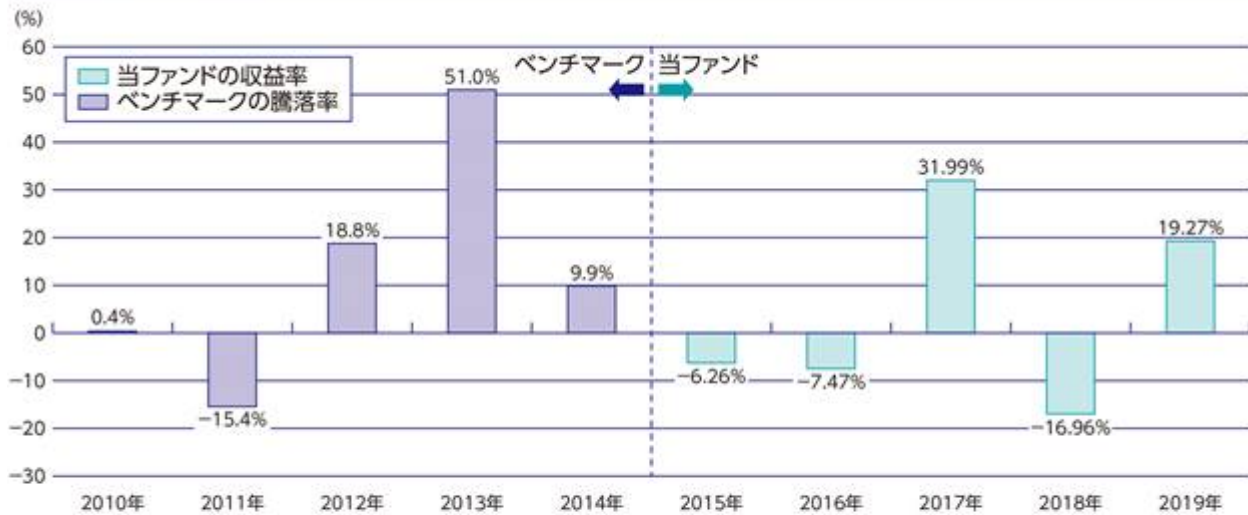
（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a = 上記期間末の１口当たり純資産価格（当該期間中の分配金の合計額を加えた額）

b = 上記期間の直前の日の１口当たり純資産価格（分配落ちの額）

< 参考情報 >

年間収益率の推移



(注1) 収益率(%)=100×(a-b)／b

a = 各暦年末現在の課税前分配金再投資換算受益証券1口当たり純資産価格

b = 当該各暦年の直前の各暦年末現在の課税前分配金再投資換算受益証券1口当たり純資産価格(ただし、2015年の場合は当初発行価格(0.01米ドル))

(注2) 当ファンドについて、2015年は7月24日(運用開始日)から12月末日までの収益率です。2019年は1月1日から11月末日までの収益率です。

(注3) ベンチマークはあくまで参考情報であり、当ファンドの運用実績ではありません。

２ 販売及び買戻しの実績

2019年11月末日までの１年間における販売および買戻しの実績ならびに2019年11月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

販売口数	買戻口数	発行済口数
59,960,196 (59,960,196)	828,945,522 (828,945,522)	3,466,828,255 (3,466,828,255)

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

[次へ](#)

３ ファンドの経理状況

- a．ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける諸法令および一般に認められた会計原則に準拠して作成された原文（英文）の中間財務書類を日本語に翻訳したものである（ただし、円換算部分を除く。）。ファンドの日本語の中間財務書類は、「中間財務諸表等の用語、様式および作成方法に関する規則」第76条第4項但書の規定に準拠して作成されている。
- b．ファンドの原文の中間財務書類は外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について2019年11月29日現在における株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝109.56円）で換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。円換算額は、四捨五入のため合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。

（１）資産及び負債の状況

ニッセイ・ケイマン・トラスト
 - ＪＰＸ日経400ジャパン・ファンド
 貸借対照表
 2019年10月31日現在
 （米ドルで表示）

	米ドル	千円
資産		
現金	2,321,226.84	254,314
銀行預金 - 外国通貨	2,321,226.84	254,314
有価証券、取得原価	26,906,235.90	2,947,847
株式、取得原価	26,906,235.90	2,947,847
未実現評価損益	8,890,114.83	974,001
未実現時価評価損益	8,592,901.06	941,438
未実現通貨運用評価損益	299,499.59	32,813
未実現通貨未決済評価損益	(1,316.00)	(144)
未実現通貨繰延評価損益	(969.82)	(106)
未収配当金	180,196.47	19,742
未収配当金	180,196.47	19,742
資産合計	38,297,774.04	4,195,904
負債		
投資受益証券	575,911.94	63,097
受益証券買戻未払金	575,911.94	63,097
未払費用	71,025.01	7,782
未払監査費用	10,131.49	1,110
未払報告書作成費用	7,665.24	840
未払投資顧問報酬	19,602.31	2,148
未払受託報酬	3,658.37	401
未払管理報酬	3,698.44	405
未払代行協会員報酬	1,543.74	169
未払販売報酬	21,610.95	2,368
未払ライセンス料	3,114.47	341
負債合計	646,936.95	70,878
資本		
ファンド受益証券	33,319,629.00	3,650,499
発行済ファンド受益証券（額面価額）	36,026,034.89	3,947,012
米ドル建 米ドルヘッジクラス	36,026,034.89	3,947,012
受益証券額面超過額	(2,706,405.89)	(296,514)
米ドル建 米ドルヘッジクラス	(2,706,405.89)	(296,514)
分配金支払額	(3,516,242.98)	(385,240)
分配金支払額	(3,516,242.98)	(385,240)
米ドル建 米ドルヘッジクラス	(3,516,242.98)	(385,240)
利益剰余金	6,113,145.24	669,756
利益剰余金	6,113,145.24	669,756
米ドル建 米ドルヘッジクラス	(3,519,649.81)	(385,613)
当期純利益	1,734,305.83	190,011
資本合計	37,650,837.09	4,125,026
負債および資本合計	38,297,774.04	4,195,904
純資産総額	37,650,837.09	4,125,026
発行済受益証券総数	3,602,603,489.00000	口
受益証券 1 口当たり純資産価格	0.010451	1円

ニッセイ・ケイマン・トラスト
- ＪＰＸ日経400ジャパン・ファンド

損益計算書

2019年５月１日から2019年10月31日までの期間

（米ドルで表示）

	米ドル	千円
費用		
費用合計	0.00	0
収益		
実現損益	(744,557.54)	(81,574)
為替取引にかかる実現利益	1,518,703.64	166,389
米ドル建 米ドルヘッジクラス	1,517,673.92	166,276
為替取引にかかる実現損失	(2,189,073.03)	(239,835)
米ドル建 米ドルヘッジクラス	(2,188,848.30)	(239,810)
時価にかかる実現利益	646,109.27	70,788
時価にかかる実現損失	(852,515.32)	(93,402)
通貨にかかる実現利益	299,119.63	32,772
米ドル建 米ドルヘッジクラス	0.02	0
通貨にかかる実現損失	(166,901.71)	(18,286)
米ドル建 米ドルヘッジクラス	(0.02)	(0)
その他の利益	(0.02)	(0)
受取配当金	268,450.18	29,411
受取配当金	268,450.18	29,411
未実現評価損益	2,559,097.29	280,375
未実現時価評価損益	1,709,801.35	187,326
未実現通貨運用評価損益	848,020.91	92,909
米ドル建 米ドルヘッジクラス	(55,844.56)	(6,118)
未実現通貨未決済評価損益	(121.48)	(13)
未実現通貨繰延評価損益	1,396.51	153
収益合計	2,082,989.93	228,212
費用		
費用 - 報酬	307,570.98	33,697
監査費用	8,041.95	881
報告書作成費用	1,216.60	133
弁護士費用	1,864.20	204
投資顧問報酬	118,626.22	12,997
受託報酬	5,624.34	616
管理報酬	22,497.35	2,465
代行協会員報酬	9,373.89	1,027
販売報酬	131,233.56	14,378
副保管報酬	7,384.76	809
ライセンス料	1,708.11	187
源泉徴収税	41,113.12	4,504
源泉徴収税	41,113.12	4,504
費用合計	348,684.10	38,202
投資純利益	1,734,305.83	190,011

[次へ](#)

（２）投資有価証券明細表等

保有有価証券残高明細表
ニッセイ・ケイマン・トラスト
- ＪＰＸ日経400ジャパン・ファンド
種別・グループ別 2019年10月31日現在

未実現損益											
口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （米ドル）	価格 / 為替レート	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （米ドル）	時価 （米ドル）	通貨 （米ドル）	合計 （米ドル）
株式											
基本素材											
11,700.00000	アイカ工業 SJPN2381 JP3100800006	7/27/2015		36,327,620	312,013.41	3,465.000000000c 108.105000000	40,540,500	375,010.41	38,970.26	24,026.74	62,997.00
27,200.00000	日産化学 SJPN2084 JP3670800006	1/22/2016		79,820,089	709,133.72	4,480.000000000c 108.105000000	121,856,000	1,127,200.41	388,843.36	29,223.33	418,066.69
8,500.00000	信越化学工業 SJPN2116 JP3371200001	11/13/2017		101,649,608	916,944.01	12,160.000000000c 108.105000000	103,360,000	956,107.49	15,821.58	23,341.90	39,163.48
47,400.00000	基本素材小計			217,797,317.00	1,938,091.14		265,756,500.00	2,458,318.31	443,635.20	76,591.97	520,227.17
通信											
18,200.00000	M o n o t a R O SJPN258L JP3922950005	7/27/2015		27,515,615	228,641.77	3,305.000000000c 108.105000000	60,151,000	556,412.75	301,885.99	25,884.99	327,770.98
22,000.00000	エス・エム・エス SJPN25GD JP3162350007	12/11/2015		27,334,557	233,327.07	2,678.000000000c 108.105000000	58,916,000	544,988.67	292,136.75	19,524.85	311,661.60
16,200.00000	ソフトバンク SJPY0005 JP3436100006	8/8/2018		85,721,579	773,552.54	4,190.000000000c 108.105000000	67,878,000	627,889.55	-165,057.85	19,394.86	-145,662.99
56,400.00000	通信小計			140,571,751.00	1,235,521.38		186,945,000.00	1,729,290.97	428,964.89	64,804.70	493,769.59
耐久消費財											
32,800.00000	バンダイナムコ ホールディングス SJPN2464 JP3778630008	7/27/2015		94,611,372	806,101.55	6,668.000000000c 108.105000000	218,710,400	2,023,129.36	1,147,949.01	69,078.80	1,217,027.81
2,100.00000	ファーストリテイリング SJPN1992 JP3802300008	8/8/2018		113,837,396	1,023,928.24	67,050.000000000c 108.105000000	140,805,000	1,302,483.70	249,457.51	29,097.95	278,555.46
75,700.00000	日野自動車 SJPN2003 JP3792600003	7/27/2015		104,089,542	865,804.30	1,032.000000000c 108.105000000	78,122,400	722,652.98	-240,202.97	97,051.65	-143,151.32
7,300.00000	イズミ SJPN254F JP3138400001	7/27/2015		37,150,446	319,196.43	4,085.000000000c 108.105000000	29,820,500	275,847.56	-67,803.95	24,455.08	-43,348.87
22,200.00000	小糸製作所 SJPN252K JP3284600008	7/27/2015		105,884,491	878,300.02	5,720.000000000c 108.105000000	126,984,000	1,174,635.77	195,176.07	101,159.68	296,335.75
11,600.00000	三菱商事 SJPN2052 JP3898400001	10/9/2018		42,020,993	371,489.13	2,764.000000000c 108.105000000	32,062,400	296,585.73	-92,119.63	17,216.23	-74,903.40
8,300.00000	スズキ SJPN2138 JP3397200001	12/13/2017		55,958,107	498,425.43	5,137.000000000c 108.105000000	42,637,100	394,404.51	-123,222.86	19,201.94	-104,020.92

未実現損益											
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （米ドル）	価格／ 為替レート	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （米ドル）	時価 （米ドル）	通貨 （米ドル）	合計 （米ドル）
株式											
耐久消費財											
3,500.00000	ツルハホールディングス	7/27/2015		38,142,281	316,529.23	12,230.000000000c	42,805,000	395,957.63	43,131.39	36,297.01	79,428.40
	SJPN2586 JP3536150000					108.105000000					
163,500.00000	耐久消費財小計			591,694,628.00	5,079,774.33		711,946,800.00	6,585,697.24	1,112,364.57	393,558.34	1,505,922.91
非耐久消費財											
49,000.00000	ベネフィット・ワン	5/18/2017		55,763,511	503,436.26	2,204.000000000c	107,996,000	998,991.72	483,164.41	12,391.05	495,555.46
	SJPN25JQ JP3835630009					108.105000000					
52,700.00000	ビジョン	7/27/2015		186,037,120	1,548,762.43	5,320.000000000c	280,364,000	2,593,441.56	872,548.73	172,130.41	1,044,679.14
	SJPN2426 JP3801600002					108.105000000					
28,600.00000	リクルートホールディングス	12/20/2018		75,262,455	677,146.21	3,611.000000000c	103,274,600	955,317.52	259,119.79	19,051.51	278,171.30
	SJPN25M0 JP3970300004					108.105000000					
35,600.00000	塩野義製薬	7/27/2015		179,042,902	1,497,396.48	6,518.000000000c	232,040,800	2,146,439.11	490,244.65	158,797.98	649,042.63
	SJPN2118 JP3347200002					108.105000000					
5,000.00000	シスメックス	4/11/2018		46,895,234	437,349.60	7,087.000000000c	35,435,000	327,783.17	-106,010.21	-3,556.21	-109,566.42
	SJPN2467 JP3351100007					108.105000000					
16,100.00000	ユニ・チャーム	3/18/2019		59,061,732	531,326.78	3,689.000000000c	59,392,900	549,400.12	3,063.39	15,009.95	18,073.34
	SJPN2509 JP3951600000					108.105000000					
1,400.00000	ＷＤＢホールディングス	4/25/2019		3,933,386	36,064.84	2,778.000000000c	3,889,200	35,976.13	-408.73	320.03	-88.70
	SJPN25SF JP3505940001					108.105000000					
188,400.00000	非耐久消費財小計			605,996,340.00	5,231,482.60		822,392,500.00	7,607,349.33	2,001,722.03	374,144.72	2,375,866.75
金融											
172,200.00000	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	12/13/2017		139,128,849	1,245,927.85	569.799987793c	98,119,558	907,632.00	-379,346.85	41,051.00	-338,295.85
	SJPN2056 JP3902900004					108.105000000					
46,600.00000	リログループ	7/27/2015		80,751,293	740,135.34	2,665.000000000c	124,189,000	1,148,781.28	401,810.34	6,835.60	408,645.94
	SJPN258E JP3755200007					108.105000000					
31,500.00000	東京海上ホールディングス	12/7/2016		161,675,488	1,426,183.76	5,868.000000000c	184,842,000	1,709,837.66	214,296.40	69,357.50	283,653.90
	SJPN2153 JP3910660004					108.105000000					
250,300.00000	金融小計			381,555,630.00	3,412,246.95		407,150,558.00	3,766,250.94	236,759.89	117,244.10	354,003.99
工業											
3,100.00000	ダイキン工業	9/19/2019		44,811,603	414,447.33	15,230.000000000c	47,213,000	436,732.81	22,213.56	71.92	22,285.48
	SJPN1980 JP3481800005					108.105000000					
4,200.00000	ファナック	1/22/2016		86,530,553	775,195.74	21,600.000000000c	90,720,000	839,184.13	38,753.50	25,234.89	63,988.39
	SJPN1991 JP3802400006					108.105000000					
5,000.00000	エフビコ	8/24/2016		28,718,089	271,476.00	6,750.000000000c	33,750,000	312,196.48	46,546.51	-5,826.04	40,720.47
	SJPN256A JP3167000003					108.105000000					
3,900.00000	キーエンス	3/28/2016		165,233,029	1,543,587.05	68,820.000000000c	268,398,000	2,482,752.88	954,303.42	-15,137.59	939,165.83
	SJPN2297 JP3236200006					108.105000000					
68,900.00000	クボタ	7/27/2015		134,244,695	1,111,212.03	1,732.000000000c	119,334,800	1,103,878.64	-137,920.49	130,587.10	-7,333.39
	SJPN2035 JP3266400005					108.105000000					

口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注１)	取得原価 (基準通貨) (注２) (米ドル)	価格／ 為替レート	価額 (表示通貨) (注１)	価額 (基準通貨) (注２) (米ドル)	時価 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
株式											
工業											
14,300.00000	日本電産 SJPN2208 JP3734800000	11/13/2015		141,820,011	1,265,644.49	16,085.0000000000c 108.1050000000	230,015,500	2,127,704.55	815,831.73	46,228.33	862,060.06
21,500.00000	オーエスジー SJPN258J JP3170800001	7/27/2015		51,484,895	426,286.30	2,337.0000000000c 108.1050000000	50,245,500	464,784.24	-11,464.73	49,962.67	38,497.94
48,900.00000	三和ホールディングス SJPN259T JP3344400001	7/27/2015		50,984,953	420,020.57	1,275.0000000000c 108.1050000000	62,347,500	576,730.96	105,106.58	51,603.80	156,710.38
4,700.00000	西日本旅客鉄道 SJPN2174 JP3659000008	1/7/2019		38,287,998	351,354.93	9,417.0000000000c 108.1050000000	44,259,900	409,415.85	55,241.68	2,819.23	58,060.91
44,800.00000	安川電機 SJPN2206 JP3932000007	7/27/2015		70,872,141	599,939.54	4,180.0000000000c 108.1050000000	187,264,000	1,732,241.80	1,076,655.65	55,646.61	1,132,302.26
219,300.00000	工業小計			812,987,967.00	7,179,163.98		1,133,548,200.00	10,485,622.34	2,965,267.41	341,190.92	3,306,458.33
テクノロジー											
104,200.00000	野村総合研究所 SJPN2383 JP3762800005	10/22/2015		148,046,701	1,250,751.51	2,311.0000000000c 108.1050000000	240,806,200	2,227,521.39	858,050.03	118,719.85	976,769.88
21,800.00000	大塚商会 SJPN2525 JP3188200004	7/27/2015		64,925,548	570,211.88	4,390.0000000000c 108.1050000000	95,702,000	885,268.95	284,690.37	30,366.71	315,057.08
6,300.00000	東京エレクトロン SJPN2156 JP3571400005	2/5/2018		110,951,160	1,008,992.13	22,075.0000000000c 108.1050000000	139,072,500	1,286,457.61	260,129.87	17,335.61	277,465.48
132,300.00000	テクノロジー小計			323,923,409.00	2,829,955.52		475,580,700.00	4,399,247.95	1,402,870.27	166,422.17	1,569,292.44
1,057,600.00000	株式合計			3,074,527,042.00	26,906,235.90		4,003,320,258.00	37,031,777.08	8,591,584.26	1,533,956.92	10,125,541.18
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
15,937,160,907.00000	日本円 日本円	MultiLot		15,937,160,907	144,024,738.23	1.0000000000s 108.1050000000	15,937,160,907	147,422,976.80	0.00	3,398,238.57	3,398,238.57
-15,801,011,843.00000	日本円 日本円	MultiLot		-15,801,011,843	-141,703,511.39	1.0000000000s 108.1050000000	-15,801,011,843	-146,163,561.75	0.00	-4,460,050.36	-4,460,050.36
136,149,064.00000	非グループ化の有価証券小計			136,149,064.00	2,321,226.84		136,149,064.00	1,259,415.05	0.00	-1,061,811.79	-1,061,811.79
136,149,064.00000	外貨建現金勘定合計			136,149,064.00	2,321,226.84		136,149,064.00	1,259,415.05	0.00	-1,061,811.79	-1,061,811.79
先渡（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
6,054.00000	JPY FORWARD 05 NOV FJP05NOV	10/29/2019		6,054	55.62	1.0000000000F 108.073785714	6,054	56.02	0.00	0.40	0.40
-1,605,508.00000	JPY FORWARD 05 NOV FJP05NOV	10/28/2019		-1,605,508	-14,732.31	1.0000000000F 108.073785714	-1,605,508	-14,855.67	0.00	-123.36	-123.36
-50,017,695.00000	JPY FORWARD 06 NOV FJP06NOV	MultiLot		-50,017,695	-459,775.11	1.0000000000F 108.067542857	-50,017,695	-462,837.35	0.00	-3,062.24	-3,062.24
-11,041,004.00000	JPY FORWARD 07 NOV FJP07NOV	MultiLot		-11,041,004	-101,460.14	1.0000000000F 108.061300000	-11,041,004	-102,173.53	0.00	-713.39	-713.39

未実現損益											
口数／金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 （表示通貨） （注１）	取得原価 （基準通貨） （注２） （米ドル）	価格／ 為替レート	価額 （表示通貨） （注１）	価額 （基準通貨） （注２） （米ドル）	時価 （米ドル）	通貨 （米ドル）	合計 （米ドル）
先渡（ポジション）											
非グループ化の有価証券											
84,506,222.00000	JPY FORWARD 29 NOV		MultiLot	84,506,222	778,305.96	1.000000000F	84,506,222	783,000.31	0.00	4,694.35	4,694.35
	FJP29NOV					107.926166667					
-4,009,553,801.00000	JPY FORWARD 29 NOV		MultiLot	-4,009,553,801	-36,977,454.77	1.000000000F	-4,009,553,801	-37,150,896.07	0.00	-173,441.30	-173,441.30
	FJP29NOV					107.926166667					
-3,987,705,732.00000	非グループ化の有価証券小計			-3,987,705,732.00	-36,775,060.75		-3,987,705,732.00	-36,947,706.29	0.00	-172,645.54	-172,645.54
-3,987,705,732.00000	先渡（ポジション）合計			-3,987,705,732.00	-36,775,060.75		-3,987,705,732.00	-36,947,706.29	0.00	-172,645.54	-172,645.54
-3,850,499,068.00000	投資明細合計			-777,029,626.00	-7,547,598.01		151,763,590.00	1,343,485.84	8,591,584.26	299,499.59	8,891,083.85

（注１）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいう。表示通貨は各投資対象により異なる。

（注２）基準通貨とは、サブ・ファンドの計理上の基準通貨をいう。サブ・ファンドの基準通貨は米ドルである。

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額（2019年11月末日現在）

払込済資本金の額	187,117,965.90米ドル（約205億円）
発行済株式総数	5,051,655株

（２）事業の内容及び営業の状況

管理会社は、投資信託の事務管理、国際的な保管業務、信託会計の事務管理およびこれらに関する一般的な銀行業務ならびに外国為替業務に従事する。

受託会社は、以下の場合、受益者決議による事前の承認を得て、管理会社に書面で通知することにより、いつでも、管理会社を解任することができるものとする。(a) 管理会社が清算手続きに入った場合（ただし、受託会社によって事前に書面で承認された（かかる承認は不当に差し控えられたり、または延期されてはならない。）条件に基づく再建または合併のための任意清算を除く。）、(b) 管理会社の資産もしくは事業の全部もしくは大部分に関し、管財人もしくは受託者が任命された場合、(c) 管理会社が債権者集会を招集した場合、またはその債権者の利益のために取決めを行った場合もしくはその提案を行った場合、もしくは示談にした場合もしくはその提案を行った場合、もしくは財産権を譲渡した場合もしくはその提案を行った場合、(d) 管理会社が業務を停止した場合、または受託会社が合理的に許可しないいずれかの会社または個人の事実上の管理下に置かれた（受託会社の合理的な判断に基づき）場合、または(e) 管理会社が信託証書に基づく管理会社の債務の重大な不履行に陥った場合で、かつ（かかる不履行が解消され得る場合においても）かかる不履行の解消を要求する受託会社からの通知を受け取った日から30日以内にかかる不履行を解消することを怠った場合。信託証書の規定に基づく管理会社の退任または解任により、(a) 信託証書は、管理会社に関し効力を有さなくなるものとする。ただし、管理会社は、信託証書に基づくその他の権利を毀損することなく、信託証書に基づき管理会社の利益となるよう管理会社に付与されたすべての補償（退任または解任にかかわらず管理会社の利益であり続ける）の恩恵を受けるものとし、かかる退任の日までに発生したものの未払いとなっているすべての報酬およびその他の金銭を受け取るものとする。(b) 管理会社は、受託会社に対しファンドの業務に関するすべての会計帳簿、記録、名簿、通信および文書、ならびに資産を受託会社に引き渡す（またはその指示に従う。）ものとし、また、ファンドに関し管理会社の名義でまたはその指示で以前に保管されていたすべての資産を受託会社に付与するあらゆる必要な措置をとるものとする。

信託証書の規定に基づき、管理会社は、いかなる損失または損害についても、かかる損失または損害が管理会社自体の詐欺、故意の債務不履行または重過失に起因するものである場合を除き、ファンド、受益者または受託会社に対していかなる責任も負わない。

受託会社（ならびにシリーズ会社およびシリーズ会社の取締役または役員）は、何時かにまたは何らかの理由によりサブ・ファンドの信託資金もしくはその一部にまたはその収益に生じるまたは課される損失、損害、請求、費用または経費について責任を負わないものとするが、かかる損失または損害が受託会社自体の詐欺、故意の債務不履行または重過失に起因するものである場合はこの限りではない。特に、以下について（ただし、これらに限られない。）受託会社は（自らの詐欺、故意の債務不履行または重過失がない場合は）いかなる負債または責任も負わないものとする。(a) 通知、決議、指図もしくはその他の文書、書類もしくは権原証書に依拠して受託会社が行ったもしくは行わなかった事柄または受託会社が真正であり、かつ、適切に可決、捺印、署名、交付もしくはその他に有効に作成されたと合理的に信じる事柄、(b) 受益証券の権原または譲渡に影響を及ぼす証明書または文書の裏書に付された署名または捺印またはその真正性の確認（受託会社は、かかる裏書、様式またはその他の文書に付された偽造のまたは不正な署名または捺印についても、偽造のまたは不正な署名または捺印に基づいて行為することまたはこれを有効なものにすることについても責任を負わないものとする。）、(c) 受託会社または管理会社のために行為する会計士、ブローカー、弁護士またはその他の代理人もしくはアドバイザーからの助言または情報に基づく行為および当該助言または情報に依拠して受託会社が行ったまたは行わなかった事柄、(d) 受託会社または管理会社の会計士、ブロー

カー、弁護士またはその他の代理人もしくはアドバイザーの違反行為、誤り、不注意、判断の誤り、または誠実さの欠缺（かかる代理人またはアドバイザーからの助言または情報は、書簡、電報、電話、テレックス・メッセージ、海底電信、ファクシミリ送信または電子メールにより付与される。）（受託会社は、かかる書簡、電報、電話、テレックス・メッセージ、海底電信、ファクシミリ送信または電子メールにより伝達されたものとみなされる助言または情報に基づく行為について、その情報が過誤を含むかまたは真正でなかった場合でも、何ら責任を負わないものとする。）、（e）信託証券の規定に基づく何らかの性質の取引から生じたまたは当該取引に関係するいずれかの法域の財務当局への公課・費用等またはその他の税金もしくは手数料もしくはその他の賦課金の支払を誠実に行ったまたは負担したことを受益者またはその他の者に説明すること、（f）適用法に基づく受益証券の登録が義務付けられた法域の在住者に対する当該受益証券の販売（信託証券第40条を損なうことなく、受託会社は、受益証券の販売または流通に関する米国、日本またはその他の証券法の違反から生じる債務について関連サブ・ファンドの信託資金から自らを補償することができる。）、（f）および受託会社の（またはその代理人の）合理的支配の及ばない事由または状況から生じるまたは当該事由または状況に起因する損失、請求または経費（信託証券に基づく業務の遅滞もしくは休止または作業停止、テロ行為、電力もしくはその他の機械的故障、コンピューター・ウィルス、自然災害、政府措置、通信途絶もしくはその他の遂行を不可能にすることによる損害を含むがこれらに限られない。）。

信託証券の他の規定にかかわらず、受託会社はいかなる場合も以下のいずれに関しても責任を負わないものとする。（a）間接的、特別または派生的な損失または損害、（b）投資運用会社の投資助言もしくは実績または投資対象の購入、選択もしくは受諾または投資対象の売却、交換もしくは変更（受託会社は、いかなる場合も、投資運用会社による裁量の行使から生じるいかなる損失についても責任を負わないものとする。）、（c）管理会社による作為もしくは不作為または管理会社もしくはその委任先から与えられた指示もしくは指図に関する行為または管理会社もしくはその委任先が受託会社に受託会社の権限、職務もしくは裁量の行使を要求もしくは請求しなかったことから生じる損失、損害、請求、費用または経費、（d）受託会社が他者から受領した情報、記録、報告およびその他のデータに依拠しそれを使用した結果生じる損失、損害、請求、費用または経費、および（e）受託会社が信託証券の規定により、管理会社もしくは受益者の指図に応じてまたは管理会社もしくは受益者の助言に基づいてまたは管理会社もしくは受益者と協議した上で行為することが義務付けられてまたは授權されており、受託会社がそのように行為した場合に生じる損失、損害、請求、費用または経費。

管理会社は、2019年10月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産価額の合計
ケイマン諸島	アンブレラ・ファンドのサブ・ファンド	37	4,991,114,304.18米ドル

（３）その他

本書提出前６か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はない。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

* _____の部分は訂正箇所を示します。

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

(3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

< 訂正前 >

(前略)

(八) 資本金の額(2019年8月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約199億円)

発行済株式総数 5,051,655株(一株37.04米ドルの記名式額面株式)

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

ただし、前記資本金の増減については、定款の規定に基づく株主総会の決議を要する。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

(八) 資本金の額(2019年11月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約205億円)

発行済株式総数 5,051,655株(一株37.04米ドルの記名式額面株式)

(注)米ドルの円貨換算は、便宜上、2019年11月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場
の仲値(1米ドル=109.56円)による。

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

ただし、前記資本金の増減については、定款の規定に基づく株主総会の決議を要する。

(後略)

4 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

(前略)

(A) 日本

2019年9月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

(A) 日本

2019年12月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)