

【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12月15日
【発行者名】	スーパーファンド・ジャパン・トレーディング (ケイマン)リミテッド (Superfund Japan Trading (Cayman) Limited)
【代表者の役職氏名】	取締役 テニソン・ブリッグス (Tennyson Briggs, Director)
【本店の所在の場所】	ケイマン諸島、KY1 - 9010、グランド・ケイマン、 クリケット・スクエア、ウィロー・ハウス4階、 キャンベルズ・コーポレート・サービシーズ・リミテッド気付 (c/o Campbells Corporate Services Limited, Floor 4, Willow House, Cricket Square, Grand Cayman, KY1-9010, Cayman Islands)
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 森 下 国 彦
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区大手町一丁目1番1号 大手町パークビルディング アンダーソン・毛利・友常法律事務所
【事務連絡者氏名】	弁護士 須 藤 綾 太 弁護士 新 實 研 人
【連絡場所】	東京都千代田区大手町一丁目1番1号 大手町パークビルディング アンダーソン・毛利・友常法律事務所
【電話番号】	03(6775)1000
【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】	スーパーファンド・ジャパン (Superfund Japan)
【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】	日本において届出の対象とされる募集受益証券の総額は、5つの サブファンドの各クラスにつき1,000億円、合計17,000億円を限 度とする。
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

(注1)本書の記載事項のうち外貨数字の円貨換算については、直近の為替レートを用いているので、訂正前の換算レートとは異なっている。本書中における米ドル及びユーロの円貨換算は、別段の表示のない限り、2020年11月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行によって公表された対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=103.89円、1ユーロ=124.38円)による。

(注2)円貨への換算は、本書において該当する各数値につき、所定の為替換算レートで単純計算の上、必要に応じて四捨五入している。したがって、本書中の同一情報につき異なった数値で円貨表示がなされている場合がある。

1【提出理由】

令和3年1月1日付で、当ファンド(スーパーファンド・ジャパン)のサブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議に基づいて償還され、受益権者は当ファンドのサブファンド「グリーンB」の対応する各クラスの受益証券を相応数、新しく獲得することとなる予定です。(なお、同日付でサブファンド「グリーンB」は、サブファンド「グリーン」へと名称が変更される予定です。)それに伴い、令和2年6月30日に提出した有価証券届出書(同年9月30日提出の有価証券届出書の訂正届出書による訂正を含みます。)の関係情報を新たな情報に訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正事項】

第一部 証券情報

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
- 2 投資方針
- 3 投資リスク
- 4 手数料等及び税金
- 5 運用状況

第2 管理及び運営

- 1 申込(販売)手続等
- 3 資産管理等の概要

第3 ファンドの経理状況

- 1 財務諸表
- 2 ファンドの現況

第三部 特別情報

第1 管理会社の概況

- 1 管理会社の概況
- 4 利害関係人との取引制限

3【訂正内容】

訂正箇所は下線で示しています。

[次へ](#)

第一部 証券情報

(2) 外国投資信託受益証券の形態等

< 訂正前 >

(前略)

(注6) 当ファンドはグリーンA、グリーンB、グリーンC、レッド、シャープパリティの5つのサブファンドから構成され、各サブファンドにつき下記(4)記載のとおり1つ又は複数のクラスを有する。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

(注6) 当ファンドは現在グリーンA、グリーンB、グリーンC、レッド、シャープパリティの5つのサブファンドから構成され、各サブファンドにつき下記(4)記載のとおり1つ又は複数のクラスを有する。ただし、2021年1月1日付でサブファンド「グリーンB」は「グリーン」へと名称変更予定であり、同日以降、サブファンド「グリーンA」の終了により当ファンドはグリーン(現時点のグリーンB)、グリーンC、レッド、シャープパリティの4つのサブファンドから構成されることとなる予定である。

(後略)

(3) 発行(売出)価額の総額

< 訂正前 >

すべてのサブファンド及びクラスについての当ファンドによる発行価額の総額(各受益証券の発行価格に発行された受益証券の数を乗じた額の合計)は17,000億円を限度とする(下記の申込手数料及び申込手数料に係る消費税等相当額は含まれない。下記「(5) 申込手数料」参照)。

(中略)

(注2) 本書の中で金額及び比率を表示する場合には、四捨五入した数値を表示するものとする。したがって、合計の数字が実際に計算された合計額と一致しない場合がある。

< 訂正後 >

すべてのサブファンド及びクラスについての当ファンドによる発行価額の総額(各受益証券の発行価格に発行された受益証券の数を乗じた額の合計)は17,000億円^(注3)を限度とする(下記の申込手数料及び申込手数料に係る消費税等相当額は含まれない。下記「(5) 申込手数料」参照)。

(中略)

(注2) 本書の中で金額及び比率を表示する場合には、四捨五入した数値を表示するものとする。したがって、合計の数字が実際に計算された合計額と一致しない場合がある。

(注3) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。クラスの減少に伴い、発行価額の総額の上限額は、2021年1月1日付で14,000億円に変更される。

(4) 発行(売出)価格

< 訂正前 >

サブファンド	クラス	
グリーンA	ゴールド円・クラス	1 □ 100円
	円・クラス	1 □ 100円
	米ドル・クラス	1 □ 1米ドル
グリーンB	円・クラス	1 □ 100円
	米ドル・クラス	1 □ 1米ドル
	ゴールド円・クラス	1 □ 100円
	ゴールド米ドル・クラス	1 □ 1米ドル

(中略)

(注)各発行日に発行された各クラスの受益証券は、当該発行日に係る評価日に当該クラスの既発行分と即座に統合され、当該評価日における当該クラスの純資産価額に応じて、申込者に発行された受益証券数が調整される。そのため、最終的には、各クラスの受益証券は、各発行日に係る評価日現在における当該クラスの1口当たりの純資産価額により、当該評価日に発行されることになる。

<訂正後>

サブファンド	クラス	
グリーンA ^(注2)	ゴールド円・クラス	1口100円
	円・クラス	1口100円
	米ドル・クラス	1口1米ドル
グリーンB ^(注3)	円・クラス	1口100円
	米ドル・クラス	1口1米ドル
	ゴールド円・クラス	1口100円
	ゴールド米ドル・クラス	1口1米ドル

(中略)

(注1)各発行日に発行された各クラスの受益証券は、当該発行日に係る評価日に当該クラスの既発行分と即座に統合され、当該評価日における当該クラスの純資産価額に応じて、申込者に発行された受益証券数が調整される。そのため、最終的には、各クラスの受益証券は、各発行日に係る評価日現在における当該クラスの1口当たりの純資産価額により、当該評価日に発行されることになる。

(注2)サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注3)サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

(6) 申込単位

<訂正前>

各クラスの最小申込単位は以下のとおりである。

サブファンド	クラス	最小申込単位
グリーンA	ゴールド円・クラス	5,000口以上、100口単位
	円・クラス	5,000口以上、100口単位
	米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位
グリーンB	円・クラス	5,000口以上、100口単位
	米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位
	ゴールド円・クラス	5,000口以上、100口単位
	ゴールド米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位

(中略)

(注1)販売会社(以下に定義する。)は、管理会社と協議の上、上記の申込単位の一部又は全部を変更することがある。

(注2)月の最終ファンド営業日にあたる評価日では、最小申込単位は、(サブファンド「グリーンC」を除き)各クラスとも1,000口以上、100口単位である。

<訂正後>

各クラスの最小申込単位は以下のとおりである。

サブファンド	クラス	最小申込単位
グリーンA ^(注3)	ゴールド円・クラス	5,000口以上、100口単位
	円・クラス	5,000口以上、100口単位
	米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位

グリーンB <small>(注4)</small>	円・クラス	5,000口以上、100口単位
	米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位
	ゴールド円・クラス	5,000口以上、100口単位
	ゴールド米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位

(中略)

(注1) 販売会社(以下に定義する。)は、管理会社と協議の上、上記の申込単位の一部又は全部を変更することがある。

(注2) 月の最終ファンド営業日にあたる評価日では、最小申込単位は、(サブファンド「グリーンC」を除き)各クラスとも1,000口以上、100口単位である。

(注3) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注4) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

(7) 申込期間

<訂正前>

2020年7月1日から2021年6月30日まで。

(後略)

<訂正後>

2020年7月1日から2021年6月30日まで。ただし、サブファンド「グリーンA」については、2020年7月1日から2020年12月31日まで。

(後略)

[次へ](#)

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

(1) ファンドの目的及び基本的性格

<訂正前>

(前略)

当ファンドは、グリーンA、グリーンB、グリーンC、レッド、シャープパリティの5つのサブファンドから構成され、第一部「証券情報」記載の通り各サブファンドにつき1つ又は複数のクラスを有する。

(中略)

サブファンド	マスターファンド/分別ポートフォリオ
グリーンA	スーパーファンド・グリーンSPC/分別ポートフォリオA スーパーファンド・グリーン・ゴールドSPC/分別ポートフォリオA
グリーンB	スーパーファンド・グリーンSPC/分別ポートフォリオB スーパーファンド・グリーン・ゴールドSPC/分別ポートフォリオB
グリーンC	スーパーファンド・グリーンSPC/分別ポートフォリオC
レッド	スーパーファンド・レッドワンSPC/分別ポートフォリオI
シャープパリティ	スーパーファンドSPC/分別ポートフォリオ・シャープパリティ

当ファンドの5つのサブファンドの一つであるレッドについては、マスターファンドであるスーパーファンド・レッドワンSPC(分別ポートフォリオI)が直接市場に投資を行う。同マスターファンドの投資目的は、(株式及びオプション市場とは実質的な相関関係を持たないことにより)証券市場の動向から潜在的に独立した投資形態を投資家に提供することであり、長期的な資本増価における平均以上の収益の確保を期待するものである。同マスターファンドの投資目的は、投資顧問会社であるスーパーファンド・アセット・マネジメントGmbH^(注)(以下「スーパーファンド・レッドワンSPC投資顧問会社」という。)が随時選定するテクニカル分析ソフトウェアの使用を通じた長期的な資本増価である。マスターファンドのクラスA(ゴールド)シェアは、金先物及び金現物の値動きに連動する(通貨から独立した)投資対象(金現物にのみ投資を行う上場投資信託等の投資対象を含む。)に資産の一部の投資することを望む投資家のために設計されている。スーパーファンド・レッドワンSPC投資顧問会社はまた、マスターファンドのクラスA(ゴールド)に代わって直接又は間接的にプラチナ及び銀並びにそれらの関連商品を含む(がそれに限られない)その他の貴金属に(またその現物に対して)投資することができる。マスターファンドの貴金属現物すべては、カストディアンにより保有される。マスターファンドは将来的にカストディアンを任命することができる。

(中略)

当ファンドの5つのサブファンドの1つであるシャープパリティについては、マスターファンドであるスーパーファンドSPC(分別ポートフォリオ・シャープパリティ)が直接市場に投資している。

(中略)

レッド及びシャープパリティ以外の3つのサブファンドについては、マスターファンド(その各分別ポートフォリオ)は、その資産の一部を分別ポートフォリオ会社として登録されている2つのケイマン

諸島の適用免除有限責任会社である、スーパーファンド・グリーン・マスター及びスーパーファンド・グリーン・ゴールド・マスターSPC(以下、それぞれを「アンダーライング・マスターファンド」という。)の株式に投資する。当ファンドの5つのサブファンド、マスターファンド、及びアンダーライング・マスターファンドとの関係については、下記(3)「ファンドの仕組み」の「当ファンドの運用ストラクチャー」を参照のこと。

(中略)

当ファンドも借入を行う権限を有し、為替ヘッジ取引に関連して借入を行うことがある。当ファンドが借入を行った場合、かかる借入金を担保するために当ファンドの資産に担保を設定することができる。各サブファンドは、当該サブファンドの純資産価額の10%を上限として借入を行うことができる。

<訂正後>

(前略)

当ファンドは、グリーンA、グリーンB、グリーンC、レッド、シャープパリティの5つのサブファンドから構成され、第一部「証券情報」記載の通り各サブファンドにつき1つ又は複数のクラスを有する。

ただし、サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。また、同日付でサブファンド「グリーンB」は、サブファンド「グリーン」へと名称が変更される予定である。

(中略)

サブファンド	マスターファンド/分別ポートフォリオ
グリーンA ^(注1)	スーパーファンド・グリーンSPC/分別ポートフォリオA スーパーファンド・グリーン・ゴールドSPC/分別ポートフォリオA
グリーンB ^(注2)	スーパーファンド・グリーンSPC/分別ポートフォリオB スーパーファンド・グリーン・ゴールドSPC/分別ポートフォリオB
グリーンC	スーパーファンド・グリーンSPC/分別ポートフォリオC
レッド	スーパーファンド・レッドワンSPC/分別ポートフォリオI

シャープパリティ スーパーファンドSPC/分別ポートフォリオ・シャープパリティ

(注1) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注2) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

当ファンドの5つのサブファンド(2021年1月1日以降は4つのサブファンド)の一つであるレッドについては、マスターファンドであるスーパーファンド・レッドワンSPC(分別ポートフォリオI)が直接市場に投資を行う。同マスターファンドの投資目的は、(株式及びオプション市場とは実質的な相関関係を持たないことにより)証券市場の動向から潜在的に独立した投資形態を投資家に提供することであり、長期的な資本増価における平均以上の収益の確保を期待するものである。同マスターファンドの投資目的は、投資顧問会社であるスーパーファンド・アセット・マネジメントGmbH^(注)(以下「スーパーファンド・レッドワンSPC投資顧問会社」という。)が随時選定するテクニカル分析ソフトウェアの

使用を通じた長期的な資本増価である。マスターファンドのクラスA(ゴールド)シェアは、金先物及び金現物の値動きに連動する(通貨から独立した)投資対象(金現物にのみ投資を行う上場投資信託等の投資対象を含む。)に資産の一部の投資することを望む投資家のために設計されている。スーパーファンド・レッドワンSPC投資顧問会社はまた、マスターファンドのクラスA(ゴールド)に代わって直接又は間接的にプラチナ及び銀並びにそれらの関連商品を含む(がそれに限られない)その他の貴金属に(またその現物に対して)投資することができる。マスターファンドの貴金属現物すべては、カストディアンにより保有される。マスターファンドは将来的にカストディアンを任命することができる。

(中略)

当ファンドの5つのサブファンド(2021年1月1日以降は4つのサブファンド)の1つであるシャープパリティについては、マスターファンドであるスーパーファンドSPC(分別ポートフォリオ・シャープパリティ)が直接市場に投資している。

(中略)

レッド及びシャープパリティ以外の3つのサブファンド(2021年1月1日以降は2つのサブファンド)については、マスターファンド(その各分別ポートフォリオ)は、その資産の一部を分別ポートフォリオ会社として登録されている2つのケイマン諸島の適用免除有限責任会社である、スーパーファンド・グリーン・マスター及びスーパーファンド・グリーン・ゴールド・マスターSPC(以下、それぞれを「アンダーライン・マスターファンド」という。)の株式に投資する。当ファンドの5つのサブファンド(2021年1月1日以降は4つのサブファンド)、マスターファンド、及びアンダーライン・マスターファンドとの関係については、下記(3)「ファンドの仕組み」の「当ファンドの運用ストラクチャー」を参照のこと。

(中略)

当ファンドも借入を行う権限を有し、為替ヘッジ取引に関連して借入を行うことがある。当ファンドが借入を行った場合、かかる借入金を担保するために当ファンドの資産に担保を設定することができる。各サブファンドは、当該サブファンドの純資産価額の10%を上限として借入を行うことができる。

ただし、サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。また、同日付でサブファンド「グリーンB」は、サブファンド「グリーン」へと名称が変更される予定である。

(2) ファンドの沿革

<訂正前>

(前略)

2020年1月1日 サブファンド「ブルー」の名称をサブファンド「シャープパリティ」に変更

<訂正後>

(前略)

2020年1月1日 サブファンド「ブルー」の名称をサブファンド「シャープパリティ」に変更

2021年1月1日 サブファンド「グリーンB」の名称をサブファンド「グリーン」に変更。

(予定) サブファンド「グリーンA」の終了。

サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで償還され、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーン」(旧サブファンド「グリーンB」)の該当クラスの受益証券が発行される。

(3) ファンドの仕組み

<訂正前>

(前略)

() ファンドの仕組み

(中略)

マスターファンドの各サブファンドは、いかなる点においても、管理会社が運用するその他のサブファンド又はその他のファンドから独立した個別のものとして管理され、本書において明示的に定める場合を除き、いかなる方法でも混合されてはならない。

(中略)

() 関係法人

(中略)

次に記載する図は当ファンドの運用ストラクチャー及び関係法人を図式化したものである。

<訂正後>

(前略)

() ファンドの仕組み

(中略)

マスターファンドの各サブファンドは、いかなる点においても、管理会社が運用するその他のサブファンド又はその他のファンドから独立した個別のものとして管理され、本書において明示的に定める場合を除き、いかなる方法でも混合されてはならない。

ただし、サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。また、同日付でサブファンド「グリーンB」は、サブファンド「グリーン」へと名称が変更される予定である。

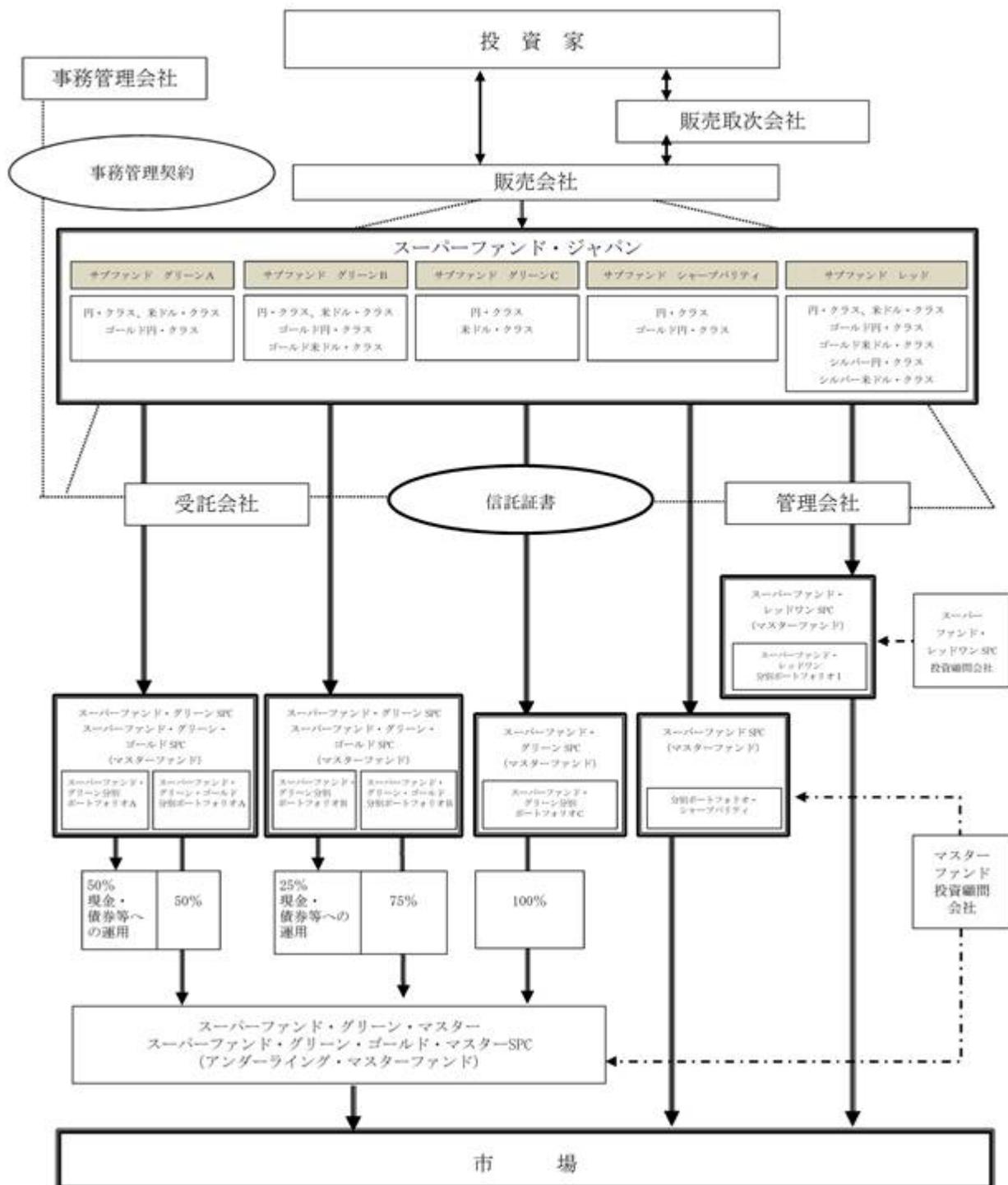
(中略)

() 関係法人

(中略)

次に記載する図は当ファンドの運用ストラクチャー及び関係法人を図式化したものである。

当ファンドの運用ストラクチャー



(注) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。また、同日付でサブファンド「グリーンB」は、サブファンド「グリーン」へと名称が変更される予定である。

(後略)

2 投資方針

(1) 投資方針

<訂正前>

(前略)

スーパーファンド・グリーン・マスター及びスーパーファンド・グリーン・ゴールド・マスターSPCは、中長期トレンドフォロー戦略を中核とした複数のテクニカル分析に基づくマネージドフューチャーズ戦略を採用する。スーパーファンド・レッドワンSPC(スーパーファンド・レッドワン分別ポートフォリオ)は、短期間のポジション保有に限定した複数のテクニカル分析に基づくマネージドフューチャーズ戦略を採用する。マネージドフューチャーズ戦略は、金融先物と商品先物双方への分散投資を行い、スーパーファンドにより独自開発されたコンピューターによる完全自動化トレーディングシステムにより運用される。スーパーファンドSPC(スーパーファンドSPC分別ポートフォリオ・シャープパリティ)は、リスク・リターン・レシオが最大となる市場セグメントをポートフォリオ内で最も重くウェイト付けするシャープパリティ戦略を採用する。株式、債券、商品市場へのバランス投資を行うシャープパリティ戦略は、スーパーファンドにより独自開発されたコンピューターによる完全自動化トレーディングシステムにより運用される。

<訂正後>

(前略)

スーパーファンド・グリーン・マスター及びスーパーファンド・グリーン・ゴールド・マスターSPCは、中長期トレンドフォロー戦略を中核とした複数のテクニカル分析に基づくマネージドフューチャーズ戦略を採用する。スーパーファンド・レッドワンSPC(スーパーファンド・レッドワン分別ポートフォリオ)は、短期間のポジション保有に限定した複数のテクニカル分析に基づくマネージドフューチャーズ戦略を採用する。マネージドフューチャーズ戦略は、金融先物と商品先物双方への分散投資を行い、スーパーファンドにより独自開発されたコンピューターによる完全自動化トレーディングシステムにより運用される。スーパーファンドSPC(スーパーファンドSPC分別ポートフォリオ・シャープパリティ)は、リスク・リターン・レシオが最大となる市場セグメントをポートフォリオ内で最も重くウェイト付けするシャープパリティ戦略を採用する。株式、債券、商品市場へのバランス投資を行うシャープパリティ戦略は、スーパーファンドにより独自開発されたコンピューターによる完全自動化トレーディングシステムにより運用される。

ただし、サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。また、同日付でサブファンド「グリーンB」は、サブファンド「グリーン」へと名称が変更される予定である。

(2) 投資対象

<訂正前>

(前略)

続いて、グリーンA及びグリーンBのマスターファンドの各サブファンドはその資産の一部をアンダーライング・マスターファンドの株式に投資する。レッド及びシャープパリティのマスターファンドはそれぞれその資産を直接市場で運用し、グリーンCのマスターファンドはその資産のすべてを対応するアンダーライング・マスターファンドに投資する。

<訂正後>

(前略)

続いて、グリーンA及びグリーンBのマスターファンドの各サブファンドはその資産の一部をアンダーライング・マスターファンドの株式に投資する。レッド及びシャープパリティのマスターファンドはそれぞれその資産を直接市場で運用し、グリーンCのマスターファンドはその資産のすべてを対応するアンダーライング・マスターファンドに投資する。

ただし、サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。また、同日付でサブファンド「グリーンB」は、サブファンド「グリーン」へと名称が変更される予定である。

(3) 運用体制

<訂正前>

当ファンドは管理会社により運用されている。管理会社は取締役により運営されており、現在、取締役はウルフ・メデック氏及びヨセフ・ホルツァー氏である。ウルフ・メデック氏は、金融業界、主に銀行、保険及び投資ファンド分野において21年余の経験を有し、ヨセフ・ホルツァー氏は、金融業界、主に金融サービス及び投資ファンドの分野において12年以上の経験を有する。取締役は、当ファンドの資産のすべてについてのマスターファンドへの投資を監督する。必要な範囲において、取締役は、当ファンドによるマスターファンドへの投資についてマスターファンド投資顧問会社及びスーパーファンド・レッドワンSPC投資顧問会社と連絡をとる。取締役はまた当ファンドの運営の全体的な管理を調整する。

現在、ウルフ・メデック氏及びヨセフ・ホルツァー氏が務めている、マスターファンドの取締役は、マスターファンドの資産のアンダーライング・マスターファンドへの投資を監視する。ウルフ・メデック氏及びヨセフ・ホルツァー氏は、アンダーライング・マスターファンドの取締役を兼務している。

<訂正後>

当ファンドは管理会社により運用されている。管理会社は取締役により運営されており、現在、取締役はテニソン・ブリッグス氏及びヨセフ・ホルツァー氏である。テニソン・ブリッグス氏は、金融業界の主に金融サービスソフトウェア分野において18年余の経験を有し、ヨセフ・ホルツァー氏は、金融業界、主に金融サービス及び投資ファンドの分野において12年以上の経験を有する。取締役は、当ファンドの資産のすべてについてのマスターファンドへの投資を監督する。必要な範囲において、取締役は、当ファンドによるマスターファンドへの投資についてマスターファンド投資顧問会社及びスーパーファンド・レッドワンSPC投資顧問会社と連絡をとる。取締役はまた当ファンドの運営の全体的な管理を調整する。

現在、テニソン・ブリッグス氏及びヨセフ・ホルツァー氏が務めている、マスターファンドの取締役は、マスターファンドの資産のアンダーライング・マスターファンドへの投資を監視する。テニソン・ブリッグス氏及びヨセフ・ホルツァー氏は、アンダーライング・マスターファンドの取締役を兼務している。

3 投資リスク

(1) リスク要因

<訂正前>

(前略)

利益相反

(中略)

ウルフ・メデック氏及びヨセフ・ホルツァー氏は、いずれも管理会社、マスターファンド及びアンダーライング・マスターファンドの取締役である。

ウルフ・メデック氏及びヨセフ・ホルツァー氏は、マスターファンド投資顧問会社、スーパーファンド・レッドワンSPC投資顧問会社、販売会社並びにマスターファンド及びアンダーライング・マスターファンドのマネジメント株式の株主と関係を有する。

(後略)

<訂正後>

(前略)

利益相反

(中略)

テニソン・ブリッグス氏及びヨセフ・ホルツァー氏は、いずれも管理会社、マスターファンド及びアンダーライング・マスターファンドの取締役である。

テニソン・ブリッグス氏及びヨセフ・ホルツァー氏は、マスターファンド投資顧問会社、スーパーファンド・レッドワンSPC投資顧問会社、販売会社並びにマスターファンド及びアンダーライング・マスターファンドのマネジメント株式の株主と関係を有する。

(後略)

(2) リスク管理

<訂正前>

(前略)

(注1) サブファンド「グリーンB(円・クラス)」、「シャープパリティ(円・クラス)(旧:ブルー(円ヘッジ有・クラス))」、「シャープパリティ(ゴールド円・クラス)(旧:ブルー(ゴールド円・クラス))」及び「レッド(円・クラス)」は、新設ファンドとして2018年1月より運用が開始されたため、2017年12月以前の情報が無い。

(注2) サブファンド「グリーンC(円・クラス)」は、新設ファンドとして2018年7月より運用が開始されたため、2018年6月以前の情報が無い。

<訂正後>

(前略)

(注1) サブファンド「グリーンB(円・クラス)」、「シャープパリティ(円・クラス)(旧:ブルー(円ヘッジ有・クラス))」、「シャープパリティ(ゴールド円・クラス)(旧:ブルー(ゴールド円・クラス))」及び「レッド(円・クラス)」は、新設ファンドとして2018年1月より運用が開始されたため、2017年12月以前の情報が無い。

(注2) サブファンド「グリーンC(円・クラス)」は、新設ファンドとして2018年7月より運用が開始されたため、2018年6月以前の情報が無い。

(注3) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注4) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

4 手数料等及び税金

(3) 管理報酬等

<訂正前>

(前略)

() 受託会社報酬

受託会社報酬は、受託会社に対し、各サブファンドの資産から毎年前払いにて下記のとおり支払われる。

各サブファンドにつき、年間8,500米ドル(約914,005円)

(中略)

() 事務管理会社報酬

単位：米ドル

	サブファンド	当ファンドの 事務管理及び 振替代行報酬 (年間)	年次報告書及び 監査手配報酬 (年間)	主たる事務所の 提供報酬(年間)
スーパーファンド・ ジャパン (「当ファンド」)	サブファンド 「グリーンA」	12,000	400	6,000
	サブファンド 「グリーンB」	12,000	400	
	サブファンド 「グリーンC」	9,800	400	
	サブファンド 「レッド」	9,793	400	
	サブファンド 「シャープパリティ」	9,793	400	

(中略)

() 販売会社報酬

(中略)

販売会社報酬は、販売の手配を行うことへの対価として支払われる。

<訂正後>

(前略)

() 受託会社報酬

受託会社報酬は、受託会社に対し、各サブファンドの資産から毎年前払いにて下記のとおり支払われる。

各サブファンドにつき、年間8,500米ドル(約914,005円)

(2021年1月1日以降は、各サブファンドにつき、年間11,000米ドル(約1,142,790円))

(中略)

() 事務管理会社報酬

単位：米ドル

	サブファンド	当ファンドの 事務管理及び 振替代行報酬 (年間)	年次報告書及び 監査手配報酬 (年間)	主たる事務所の 提供報酬(年間)
スーパーファンド・ ジャパン (「当ファンド」)	サブファンド 「グリーンA」(注1)	12,000	400	6,000
	サブファンド 「グリーンB」(注2)	12,000	400	
	サブファンド 「グリーンC」	9,800	400	
	サブファンド 「レッド」	9,793	400	
	サブファンド 「シャープパリティ」	9,793	400	

(注1) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注2) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

(中略)

() 販売会社報酬

(中略)

販売会社報酬は、販売の手配を行うことへの対価として支払われる。

ただし、サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。また、同日付でサブファンド「グリーンB」は、サブファンド「グリーン」へと名称が変更される予定である。

(4) その他の手数料等

<訂正前>

() マスターファンド及びアンダーライニング・マスターファンドから支払われるべき手数料

(中略)

マスターファンド及びアンダーライニング・マスターファンドの事務管理会社(以下「マスターファンド事務管理会社」という。)は、下表に示す年間報酬を受領する権限を有する。

(後略)

<訂正後>

() マスターファンド及びアンダーライニング・マスターファンドから支払われるべき手数料

(中略)

マスターファンド及びアンダーライニング・マスターファンドの事務管理会社(以下「マスターファンド事務管理会社」という。)は、下表に示す年間報酬を受領する権限を有する。

ただし、サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。また、同日付でサブファンド「グリーンB」は、サブファンド「グリーン」へと名称が変更される予定である。

(後略)

5 運用状況

(1) 投資状況

<訂正前>

(2020年6月30日現在)

	資産の種類	国名	時価合計 円	投資比率
グリーンA	スーパーファンド・グリーン・ ゴールドSPCの株式(クラスA)及び スーパーファンド・グリーンSPCの株式 (クラスA)	ケイマン諸島	310,663,672	98.57%
	現金、受取債権及びその他の資産 (負債控除後)	該当なし	4,518,139	1.43%
	純資産総額		315,181,811	100.00%
グリーンB	資産の種類	国名	時価合計 円	投資比率
	スーパーファンド・グリーン・ ゴールドSPCの株式(クラスB)及び スーパーファンド・グリーンSPCの株式 (クラスB)	ケイマン諸島	1,731,650,718	99.98%
	現金、受取債権及びその他の資産 (負債控除後)	該当なし	380,826	0.02%
	純資産総額		1,732,031,544	100.00%
グリーンC	資産の種類	国名	時価合計 円	投資比率
	スーパーファンド・グリーンSPCの株式 (クラスC)	ケイマン諸島	400,516,708	99.00%
	現金、受取債権及びその他の資産 (負債控除後)	該当なし	4,037,467	1.00%
	純資産総額		404,554,175	100.00%
レッド	資産の種類	国名	時価合計 米ドル (円)	投資比率
	スーパーファンド・レッドワンSPCの 株式(クラス・ジャパン)	ケイマン諸島	6,873,929.07 (724,237,167)	99.74%
	現金、受取債権及びその他の資産 (負債控除後)	該当なし	17,664.28 (1,861,109)	0.26%
	純資産総額		6,891,593.35 (726,098,275)	100.00%
シャープパリティ ^(注)	資産の種類	国名	時価合計 円	投資比率
	スーパーファンドSPCの株式(分別ポ ートフォリオ・シャープパリティ・クラス Bジャパン)	ケイマン諸島	230,604,897	98.20%
	現金、受取債権及びその他の資産 (負債控除後)	該当なし	4,223,683	1.80%
	純資産総額		234,828,580	100.00%

(注) サブファンド「ブルー」は、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」と名称が変更された。

<訂正後>

(2020年6月30日現在)

	資産の種類	国名	時価合計 円	投資比率
グリーンA(注1)	スーパーファンド・グリーン・ ゴールドSPCの株式(クラスA)及び スーパーファンド・グリーンSPCの株式 (クラスA)	ケイマン諸島	310,663,672	98.57%
	現金、受取債権及びその他の資産 (負債控除後)	該当なし	4,518,139	1.43%
	純資産総額		315,181,811	100.00%
	資産の種類	国名	時価合計 円	投資比率
グリーンB(注2)	スーパーファンド・グリーン・ ゴールドSPCの株式(クラスB)及び スーパーファンド・グリーンSPCの株式 (クラスB)	ケイマン諸島	1,731,650,718	99.98%
	現金、受取債権及びその他の資産 (負債控除後)	該当なし	380,826	0.02%
	純資産総額		1,732,031,544	100.00%
	資産の種類	国名	時価合計 円	投資比率
グリーンC	スーパーファンド・グリーンSPCの株式 (クラスC)	ケイマン諸島	400,516,708	99.00%
	現金、受取債権及びその他の資産 (負債控除後)	該当なし	4,037,467	1.00%
	純資産総額		404,554,175	100.00%
	資産の種類	国名	時価合計 米ドル (円)	投資比率
レッド	スーパーファンド・レッドワンSPCの 株式(クラス・ジャパン)	ケイマン諸島	6,873,929.07 (714,132,491)	99.74%
	現金、受取債権及びその他の資産 (負債控除後)	該当なし	17,664.28 (1,835,142)	0.26%
	純資産総額		6,891,593.35 (715,967,633)	100.00%
	資産の種類	国名	時価合計 円	投資比率
シャープパリティ	スーパーファンドSPCの株式(分別ポ ートフォリオ・シャープパリティ・クラス Bジャパン)	ケイマン諸島	230,604,897	98.20%
	現金、受取債権及びその他の資産 (負債控除後)	該当なし	4,223,683	1.80%
	純資産総額		234,828,580	100.00%

(注1) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注2) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

(2) 投資資産

<訂正前>

投資有価証券の主要銘柄

(2020年6月30日現在)

サブ ファンド	発行地	銘柄	業種	数量	金額(簿価)	金額(時価)	投資 比率
グリーンA	ケイマン 諸島	スーパーファンド・ グリーン・ゴールド SPCの株式(クラス A)及び スーパーファンド グリーンSPCの株式 (クラスA)	分別 ポート フォリオ 会社	272,234.89	247,321,439円	310,663,670円	100%
					単価 908.49円	単価 1,141.16円	
グリーンB	ケイマン 諸島	スーパーファンド・ グリーン・ゴールド SPCの株式(クラス B)及び スーパーファンド・ グリーンSPCの株式 (クラスB)	分別 ポート フォリオ 会社	1,544,194.19	1,542,412,929円	1,731,650,714円	100%
					単価 998.85円	単価 1,121.39円	
グリーンC	ケイマン 諸島	スーパーファンド・ グリーンSPCの株式 (クラスC)	分別 ポート フォリオ 会社	359,222.05	353,571,710円	400,516,708円	100%
					単価 984.27円	単価 1,114.96円	
レッド	ケイマン 諸島	スーパーファンド・ レッドワンSPCの株式 (クラス・ジャパ ン)	分別 ポート フォリオ 会社	7,013.67	6,988,604.97米ドル (736,319,420円)	6,873,929.08米ドル (724,237,168円)	100%
					単価 996.43米ドル (104,984円)	単価 980.08米ドル (103,261円)	
シャープパ リティ (注)	ケイマン 諸島	スーパーファンドSPC の株式(分別ポート フォリオ・シャープ パリティ・クラスB ジャパン)	分別 ポート フォリオ 会社	116,158.93	363,705,741円	230,604,902円	100%
					単価 3,131.10円	単価 1,985.25円	

(注) サブファンド「ブルー」は、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」と名称が変更された。

(後略)

<訂正後>

投資有価証券の主要銘柄

(2020年6月30日現在)

サブ ファンド	発行地	銘柄	業種	数量	金額(簿価)	金額(時価)	投資 比率
グリーンA (注1)	ケイマン 諸島	スーパーファンド・ グリーン・ゴールド SPCの株式(クラス A)及び スーパーファンド・ グリーンSPCの株式 (クラスA)	分別 ポート フォリオ 会社	272,234.89	247,321,439円	310,663,670円	100%
					単価 908.49円	単価 1,141.16円	
グリーンB (注2)	ケイマン 諸島	スーパーファンド・ グリーン・ゴールド SPCの株式(クラス B)及び スーパーファンド・ グリーンSPCの株式 (クラスB)	分別 ポート フォリオ 会社	1,544,194.19	1,542,412,929円	1,731,650,714円	100%
					単価 998.85円	単価 1,121.39円	
グリーンC	ケイマン 諸島	スーパーファンド・ グリーンSPCの株式 (クラスC)	分別 ポート フォリオ 会社	359,222.05	353,571,710円	400,516,708円	100%
					単価 984.27円	単価 1,114.96円	

レッド	ケイマン 諸島	スーパーファンド・ レッドワンSPCの株式 (クラス・ジャパ ン)	分別 ポート フォリオ 会社	7,013.67	6,988,604.97米ドル (726,046,170円)	6,873,929.08米ドル (714,132,492円)	100%
					単価 996.43米ドル (103,519円)	単価 980.08米ドル (101,821円)	
シャープパ リティ	ケイマン 諸島	スーパーファンドSPC の株式(分別ポート フォリオ・シャープ パリティ・クラスB ジャパン)	分別 ポート フォリオ 会社	116,158.93	363,705,741円	230,604,902円	100%
					単価 3,131.10円	単価 1,985.25円	

(注1) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注2) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

(後略)

(3) 運用実績

<訂正前>

*サブファンド「グリーンA」及びサブファンド「グリーンB」の受益証券は、当初設立(2009年)以降2017年12月31日まで、約2ヵ月毎の申込期間に対応して異なるシリーズとして発行されたが、その後順次当初シリーズに統合された。

純資産の推移

(a) 純資産総額の推移

*下記表中の「サブファンドA 円建てクラス」は現在のサブファンド「グリーンA」ゴールド円・クラス、「サブファンドB 円建てクラス」は現在のサブファンド「グリーンB」ゴールド円・クラスである(以下同じ)。

(中略)

(注1) 2018年1月1日以降、「サブファンドA 円建てクラス」はサブファンド「グリーンA」ゴールド円・クラス、「サブファンドB 円建てクラス」はサブファンド「グリーンB」ゴールド円・クラスとして運用されている。

(注2) サブファンド「グリーンB」円・クラス、米ドル・クラス、ゴールド米ドル・クラス、サブファンド「レッド」及びサブファンド「ブルー」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年1月より運用が開始されたため、2017年12月以前の情報が無い。

(注3) サブファンド「グリーンA」円・クラス、米ドル・クラス及びサブファンド「グリーンC」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年7月より運用が開始されたため、2018年6月以前の情報が無い。

(注4) サブファンド「ブルー」円ヘッジ有・クラス及びサブファンド「ブルー」ゴールド円・クラスは、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」円・クラス及びサブファンド「シャープパリティ」ゴールド円・クラスとそれぞれ名称が変更された。

(b) 1口当たりの純資産価額の推移

(中略)

(注1) 2018年1月1日以降、「サブファンドA 円建てクラス」はサブファンド「グリーンA」ゴールド円・クラス、「サブファンドB 円建てクラス」はサブファンド「グリーンB」ゴールド円・クラスとして運用されている。

(注2) サブファンド「グリーンB」円・クラス、米ドル・クラス、ゴールド米ドル・クラス、サブファンド「レッド」及びサブファンド「ブルー」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年1月より運用が開始されたため、2017年12月以前の情報が無い。

(注3) サブファンド「グリーンA」円・クラス、米ドル・クラス及びサブファンド「グリーンC」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年7月より運用が開始されたため、2018年6月以前の情報が無い。

(注4) サブファンド「ブルー」円ヘッジ有・クラス及びサブファンド「ブルー」ゴールド円・クラスは、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」円・クラス及びサブファンド「シャープパリティ」ゴールド円・クラスとそれぞれ名称が変更された。

(中略)

収益率の推移

(中略)

(注1) 2018年1月1日以降、「サブファンドA 円建てクラス」はサブファンド「グリーンA」ゴールド円・クラス、「サブファンドB 円建てクラス」はサブファンド「グリーンB」ゴールド円・クラスとして運用されている。

(注2) サブファンド「グリーンB」円・クラス、米ドル・クラス、ゴールド米ドル・クラス、サブファンド「レッド」及びサブファンド「ブルー」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年1月より運用が開始されたため、2017年12月31日以前の情報が無い。

- (注3) サブファンド「グリーンA」円・クラス、米ドル・クラス及びサブファンド「グリーンC」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年7月より運用が開始されたため、2018年6月30日以前の情報が無い。
- (注4) サブファンド「ブルー」円ヘッジ有・クラス及びサブファンド「ブルー」ゴールド円・クラスは、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」円・クラス及びサブファンド「シャープパリティ」ゴールド円・クラスとそれぞれ名称が変更された。

<訂正後>

*サブファンド「グリーンA」(当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で完全に償還予定)及びサブファンド「グリーンB」(2021年1月1日付でサブファンド「グリーン」に名称を変更予定)の受益証券は、当初設立(2009年)以降2017年12月31日まで、約2ヵ月毎の申込期間に対応して異なるシリーズとして発行されたが、その後順次当初シリーズに統合された。

純資産の推移

(a) 純資産総額の推移

*下記表中の「サブファンドA 円建てクラス」は現在のサブファンド「グリーンA」ゴールド円・クラス(当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で完全に償還予定)、「サブファンドB 円建てクラス」は現在のサブファンド「グリーンB」ゴールド円・クラス(2021年1月1日付でサブファンド「グリーン」ゴールド円・クラスに名称を変更予定)である(以下同じ)。

(中略)

- (注1) 2018年1月1日以降、「サブファンドA 円建てクラス」はサブファンド「グリーンA」ゴールド円・クラス、「サブファンドB 円建てクラス」はサブファンド「グリーンB」ゴールド円・クラスとして運用されている。
- (注2) サブファンド「グリーンB」円・クラス、米ドル・クラス、ゴールド米ドル・クラス、サブファンド「レッド」及びサブファンド「ブルー」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年1月より運用が開始されたため、2017年12月以前の情報が無い。
- (注3) サブファンド「グリーンA」円・クラス、米ドル・クラス及びサブファンド「グリーンC」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年7月より運用が開始されたため、2018年6月以前の情報が無い。
- (注4) サブファンド「ブルー」円ヘッジ有・クラス及びサブファンド「ブルー」ゴールド円・クラスは、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」円・クラス及びサブファンド「シャープパリティ」ゴールド円・クラスとそれぞれ名称が変更された。
- (注5) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。
- (注6) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

(b) 1口当たりの純資産価額の推移

(中略)

- (注1) 2018年1月1日以降、「サブファンドA 円建てクラス」はサブファンド「グリーンA」ゴールド円・クラス、「サブファンドB 円建てクラス」はサブファンド「グリーンB」ゴールド円・クラスとして運用されている。
- (注2) サブファンド「グリーンB」円・クラス、米ドル・クラス、ゴールド米ドル・クラス、サブファンド「レッド」及びサブファンド「ブルー」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年1月より運用が開始されたため、2017年12月以前の情報が無い。
- (注3) サブファンド「グリーンA」円・クラス、米ドル・クラス及びサブファンド「グリーンC」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年7月より運用が開始されたため、2018年6月以前の情報が無い。
- (注4) サブファンド「ブルー」円ヘッジ有・クラス及びサブファンド「ブルー」ゴールド円・クラスは、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」円・クラス及びサブファンド「シャープパリティ」ゴールド円・クラスとそれぞれ名称が変更された。
- (注5) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。
- (注6) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

(中略)

収益率の推移

(中略)

- (注1) 2018年1月1日以降、「サブファンドA 円建てクラス」はサブファンド「グリーンA」ゴールド円・クラス、「サブファンドB 円建てクラス」はサブファンド「グリーンB」ゴールド円・クラスとして運用されている。

- (注2)サブファンド「グリーンB」円・クラス、米ドル・クラス、ゴールド米ドル・クラス、サブファンド「レッド」及びサブファンド「ブルー」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年1月より運用が開始されたため、2017年12月31日以前の情報が無い。
- (注3)サブファンド「グリーンA」円・クラス、米ドル・クラス及びサブファンド「グリーンC」は、新設クラス及び新設ファンドとして2018年7月より運用が開始されたため、2018年6月30日以前の情報が無い。
- (注4)サブファンド「ブルー」円ヘッジ有・クラス及びサブファンド「ブルー」ゴールド円・クラスは、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」円・クラス及びサブファンド「シャープパリティ」ゴールド円・クラスとそれぞれ名称が変更された。
- (注5)サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。
- (注6)サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

(4) 販売及び買戻しの実績

< 訂正前 >

(前略)

(自2019年8月1日至2020年7月31日)

サブ ファンド	クラス	販売受益証券数 (口)	買戻受益証券数 (口)	発行済受益証券数 (口)

(中略)

(注1) () は、本邦内で行われたものを内数で表している。

(注2)サブファンド「ブルー」円ヘッジ有・クラス及びサブファンド「ブルー」ゴールド円・クラスは、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」円・クラス及びサブファンド「シャープパリティ」ゴールド円・クラスとそれぞれ名称が変更された。

< 訂正後 >

(前略)

(自2019年8月1日至2020年7月31日)

サブ ファンド	クラス	販売受益証券数 (口)	買戻受益証券数 (口)	発行済受益証券数 (口)

(中略)

(注1) () は、本邦内で行われたものを内数で表している。

(注2)サブファンド「ブルー」円ヘッジ有・クラス及びサブファンド「ブルー」ゴールド円・クラスは、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」円・クラス及びサブファンド「シャープパリティ」ゴールド円・クラスとそれぞれ名称が変更された。

(注3)サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注4)サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

第2 管理及び運営

1 申込(販売)手続等

<訂正前>

(1) 申込(販売)期間

2020年7月1日から2021年6月30日まで。

(2) 受益証券の価格

サブファンド	クラス	
グリーンA	ゴールド円・クラス	1口100円
	円・クラス	1口100円
	米ドル・クラス	1口1米ドル
グリーンB	円・クラス	1口100円
	米ドル・クラス	1口1米ドル
	ゴールド円・クラス	1口100円
	ゴールド米ドル・クラス	1口1米ドル

(中略)

(注1) 各発行日(以下に定義する。)に発行された各クラスの受益証券は、当該発行日に係る評価日に当該クラスの既発行分と即座に統合され、当該評価日における当該クラスの純資産価額に応じて、受益証券の申込希望者(以下「申込者」という。)に発行された受益証券数が調整される。そのため、最終的には、各クラスの受益証券は、各発行日に係る評価日現在における当該クラスの1口当たりの純資産価額により、当該評価日に発行されることになる。

(注2) 「発行日」とは、申込及び申込金の支払の直後に到来する評価日を意味する。但し、受益証券の発行及び登録は、該当する評価日(以下「申込金受領期日」という。)の午後3時(東京時間)頃、受益証券の申込金の全額の支払いが確認されたときに法的に有効となる。

(3) 最小申込単位

サブファンド	クラス	最小申込単位
グリーンA	ゴールド円・クラス	5,000口以上、100口単位
	円・クラス	5,000口以上、100口単位
	米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位
グリーンB	円・クラス	5,000口以上、100口単位
	米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位
	ゴールド円・クラス	5,000口以上、100口単位
	ゴールド米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位

(中略)

(注) 月の最終ファンド営業日にあたる評価日では、最小申込単位は、(サブファンド「グリーンC」を除き)各クラスとも1,000口以上、100口単位である。

(後略)

<訂正後>

(1) 申込(販売)期間

2020年7月1日から2021年6月30日まで。ただし、サブファンド「グリーンA」については、2020年7月1日から2020年12月31日まで。

(2) 受益証券の価格

サブファンド	クラス	
グリーンA ^(注3)	ゴールド円・クラス	1口100円
	円・クラス	1口100円
	米ドル・クラス	1口1米ドル
グリーンB ^(注4)	円・クラス	1口100円
	米ドル・クラス	1口1米ドル
	ゴールド円・クラス	1口100円
	ゴールド米ドル・クラス	1口1米ドル

(中略)

(注1) 各発行日(以下に定義する。)に発行された各クラスの受益証券は、当該発行日に係る評価日に当該クラスの既発行分と即座に統合され、当該評価日における当該クラスの純資産価額に応じて、受益証券の申込希望者(以下「申込者」という。)に発行された受益証券数が調整される。そのため、最終的には、各クラスの受益証券は、各発行日に係る評価日現在における当該クラスの1口当たりの純資産価額により、当該評価日に発行されることになる。

(注2) 「発行日」とは、申込及び申込金の支払の直後に到来する評価日を意味する。但し、受益証券の発行及び登録は、該当する評価日(以下「申込金受領期日」という。)の午後3時(東京時間)頃、受益証券の申込金の全額の支払いが確認されたときに法的に有効となる。

(注3) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注4) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

(3) 最小申込単位

サブファンド	クラス	最小申込単位
グリーンA ^(注2)	ゴールド円・クラス	5,000口以上、100口単位
	円・クラス	5,000口以上、100口単位
	米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位
グリーンB ^(注3)	円・クラス	5,000口以上、100口単位
	米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位
	ゴールド円・クラス	5,000口以上、100口単位
	ゴールド米ドル・クラス	5,000口以上、100口単位

(中略)

(注1) 月の最終ファンド営業日にあたる評価日では、最小申込単位は、(サブファンド「グリーンC」を除き)各クラスとも1,000口以上、100口単位である。

(注2) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注3) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

(後略)

3 資産管理等の概要

(1) 資産の評価

<訂正前>

() 資産の評価

(前略)

サブファンドの純資産価額とは、サブファンドの受益証券の各クラスに帰属せしめられるサブファンドの資産を公正な市場価格で評価したものをいい、既発生かつ未払の費用及び特定の状況のための留保金を含む一切の負債を差し引いて評価される。「受益証券1口当たりの純資産額」とは、当該受益証券がその一部を形成する、受益証券の各クラスに適正に帰属せしめられるサブファンドの純資産価額を、発行済未償還の各クラスの受益証券数で除したものをいう。受益証券1口当たりの純資産額は、円建てのクラス及び米ドル建てのクラスに関しては、サブファンド「レッド」においては小数点第4位まで、サブファンド「グリーンA」、「グリーンB」、「グリーンC」及びサブファンド「シャープパリティ」においては小数点第2位まで計算する。純資産価額の計算結果は、代行協会員によってJSDAに毎月報告され、受益権者に開示される。費用、手数料及びその他の負債は、実行可能な限り、米国の一般会計原則に従って処理されるものとする。

(後略)

<訂正後>

() 資産の評価

(前略)

サブファンドの純資産価額とは、サブファンドの受益証券の各クラスに帰属せしめられるサブファンドの資産を公正な市場価格で評価したものをいい、既発生かつ未払の費用及び特定の状況のための留保金を含む一切の負債を差し引いて評価される。「受益証券1口当たりの純資産額」とは、当該受益証券がその一部を形成する、受益証券の各クラスに適正に帰属せしめられるサブファンドの純資産価額を、発行済未償還の各クラスの受益証券数で除したものをいう。受益証券1口当たりの純資産額は、円建てのクラス及び米ドル建てのクラスに関しては、サブファンド「レッド」においては小数点第4位まで、サブファンド「グリーン」、「グリーンC」及びサブファンド「シャープパリティ」においては小数点第2位まで計算する。純資産価額の計算結果は、代行協会員によってJSDAに毎月報告され、受益権者に開示される。費用、手数料及びその他の負債は、実行可能な限り、米国の一般会計原則に従って処理されるものとする。

ただし、サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。また、同日付でサブファンド「グリーンB」は、サブファンド「グリーン」へと名称が変更される予定である。

(後略)

[次へ](#)

第3 ファンドの経理状況

1 財務諸表

(3) 投資有価証券明細表等

株式以外の投資有価証券明細表

<訂正前>

(2020年7月31日現在)

サブファンド		国	公正価額
グリーンA	スーパーファンド・グリーンSPC Aの株式 (クラスA・ジャパン)	ケイマン 諸島	91,688,981円
	スーパーファンド・グリーン・ゴールドSPC Aの株式 (クラス・ジャパン)	ケイマン 諸島	239,019,431円
グリーンB	スーパーファンド・グリーンSPC Bの株式 (クラスB・ジャパン)	ケイマン 諸島	882,993,594円
	スーパーファンド・グリーン・ゴールドSPC Bの株式 (クラスB・ジャパン)	ケイマン 諸島	990,139,297円
グリーンC	スーパーファンド・グリーンSPC Cの株式 (クラス・ジャパン)	ケイマン 諸島	424,210,726円
レッド	スーパーファンド・レッドワンSPCの株式 (クラス・ジャパン・米ドル)	ケイマン 諸島	1,509,798.70 米ドル (159,072,391 円)
	スーパーファンド・レッドワンSPCの株式 (クラス・ジャパン・ゴールド)	ケイマン 諸島	2,522,238.37 米ドル (265,743,035 円)
	スーパーファンド・レッドワンSPCの株式 (クラス・ジャパン・シルバー)	ケイマン 諸島	4,142,711.71 米ドル (436,476,106 円)
シャープパリティ ^(注)	スーパーファンド・SPCの株式 (分別ポートフォリオ・シャープパリティ・クラス Bジャパン)	ケイマン 諸島	66,481,795円
	スーパーファンド・SPCの株式 (分別ポートフォリオ・シャープパリティ・クラス Bジャパン)	ケイマン 諸島	1,530,772.04 ユーロ (192,065,968 円)

(注) サブファンド「ブルー」は、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」と名称が変更された。

<訂正後>

(2020年7月31日現在)

サブファンド		国	公正価額
グリーンA(注1)	スーパーファンド・グリーンSPC Aの株式 (クラスA・ジャパン)	ケイマン 諸島	91,688,981円
	スーパーファンド・グリーン・ゴールドSPC Aの株式 (クラス・ジャパン)	ケイマン 諸島	239,019,431円
グリーンB(注2)	スーパーファンド・グリーンSPC Bの株式 (クラスB・ジャパン)	ケイマン 諸島	882,993,594円
	スーパーファンド・グリーン・ゴールドSPC Bの株式 (クラスB・ジャパン)	ケイマン 諸島	990,139,297円
グリーンC	スーパーファンド・グリーンSPC Cの株式 (クラス・ジャパン)	ケイマン 諸島	424,210,726円
レッド	スーパーファンド・レッドワンSPCの株式 (クラス・ジャパン・米ドル)	ケイマン 諸島	1,509,798.70 米ドル (156,852,987 円)
	スーパーファンド・レッドワンSPCの株式 (クラス・ジャパン・ゴールド)	ケイマン 諸島	2,522,238.37 米ドル (262,035,344 円)
	スーパーファンド・レッドワンSPCの株式 (クラス・ジャパン・シルバー)	ケイマン 諸島	4,142,711.71 米ドル (430,386,319 円)
シャープパリティ	スーパーファンド・SPCの株式 (分別ポートフォリオ・シャープパリティ・クラス Bジャパン)	ケイマン 諸島	66,481,795円
	スーパーファンド・SPCの株式 (分別ポートフォリオ・シャープパリティ・クラス Bジャパン)	ケイマン 諸島	1,530,772.04 ユーロ (190,397,426 円)

(注1) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、
2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブ
ファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注2) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

2 ファンドの現況

純資産額計算書

<訂正前>

(2020年7月31日現在)

グリーンA	資産総額(円)	335,817,644
	負債総額(円)	381,126
	純資産総額(-)(円)	335,436,518
	発行済数量	3,639,527
	1単位当たり純資産額(/)(円)	92.16
グリーンB	資産総額(円)	1,939,978,921
	負債総額(円)	64,347,888
	純資産総額(-)(円)	1,875,631,033
	発行済数量	17,634,021
	1単位当たり純資産額(/)(円)	106.36
グリーンC	資産総額(円)	429,111,681
	負債総額(円)	316,193
	純資産総額(-)(円)	428,795,488
	発行済数量	4,979,011
	1単位当たり純資産額(/)(円)	86.12
レッド	資産総額(米ドル)	8,211,324 (865,145,097円)
	負債総額(米ドル)	7,953 (837,928円)
	純資産総額(-)(米ドル)	8,203,371 (864,307,169円)
	発行済数量	10,576,221
	1単位当たり純資産額(/)(米ドル)	0.78 (82.18円)
シャープパリティ(注2)	資産総額(円)	263,271,319
	負債総額(円)	357,693
	純資産総額(-)(円)	262,913,626
	発行済数量	4,574,665
	1単位当たり純資産額(/)(円)	57.47

(注1)各シリーズに係る1単位当たり純資産額についての詳細な情報は、「第二部 ファンド情報、第1 ファンドの状況、5 運用状況、(3)運用実績、純資産の推移、(b)1口当たりの純資産額の推移」を参照されたい。

(注2)サブファンド「ブルー」は、2020年1月1日付で、サブファンド「シャープパリティ」と名称が変更された。

<訂正後>

(2020年7月31日現在)

グリーンA <small>(注2)</small>	資産総額(円)	335,817,644
	負債総額(円)	381,126
	純資産総額(-)(円)	335,436,518
	発行済数量	3,639,527
	1単位当たり純資産額(/)(円)	92.16
グリーンB <small>(注3)</small>	資産総額(円)	1,939,978,921
	負債総額(円)	64,347,888
	純資産総額(-)(円)	1,875,631,033
	発行済数量	17,634,021
	1単位当たり純資産額(/)(円)	106.36
グリーンC	資産総額(円)	429,111,681
	負債総額(円)	316,193
	純資産総額(-)(円)	428,795,488
	発行済数量	4,979,011
	1単位当たり純資産額(/)(円)	86.12
レッド	資産総額(米ドル)	8,211,324 (853,074,450円)
	負債総額(米ドル)	7,953 (826,237円)
	純資産総額(-)(米ドル)	8,203,371 (852,248,213円)
	発行済数量	10,576,221
	1単位当たり純資産額(/)(米ドル)	0.78 (81.03円)
シャープパリティ	資産総額(円)	263,271,319
	負債総額(円)	357,693
	純資産総額(-)(円)	262,913,626
	発行済数量	4,574,665
	1単位当たり純資産額(/)(円)	57.47

(注1) 各シリーズに係る1単位当たり純資産額についての詳細な情報は、「第二部 ファンド情報、第1 ファンドの状況、5 運用状況、(3) 運用実績、純資産の推移、(b) 1口当たりの純資産額の推移」を参照されたい。

(注2) サブファンド「グリーンA」の受益証券は、当該サブファンドの登録受益権者による決議等の手続きを経たうえで、2021年1月1日付で償還される予定であり、サブファンド「グリーンA」の受益者には償還手続きの過程においてサブファンド「グリーンB」の該当クラスの受益証券が発行される予定である。

(注3) サブファンド「グリーンB」は、2021年1月1日付で、サブファンド「グリーン」と名称が変更される予定である。

[次へ](#)

第三部 特別情報

第1 管理会社の概況

1 管理会社の概況

<訂正前>

(前略)

(2) 管理会社の組織

(中略)

現在の管理会社の取締役は、ウルフ・メデック氏及びヨセフ・ホルツァー氏である。

ウルフ・メデック氏は、1996年にオーストリアはウィーンのウィーン大学法学部を法学マギスターとして卒業した。1997年から2016年まで、メデック氏はアリアンツ・オーストリア・グループの銀行、生命保険会社及び年金基金において様々な役員及び非役員を務めた。同氏は2016年9月に投資会社からなるスーパーファンド・グループにスーパーファンド・アセット・マネジメントGmbHの法務部門代表として入社し、2017年以降ルクセンブルクSICAVの取締役を務めている。メデック氏はオーストリア国籍を有する。

(後略)

<訂正後>

(前略)

(2) 管理会社の組織

(中略)

現在の管理会社の取締役は、テニソン・ブリッグス氏及びヨセフ・ホルツァー氏である。

テニソン・ブリッグス氏は、関連会社からなるスーパーファンド・グループに18年以上在籍している。同氏はマイクロソフト認定プロフェッショナルデベロッパーとして、データ分析、受注管理、バックオフィスにおける取引調整及び収支会計といった取引プロセス全体において使用される重要なインフラストラクチャー・システムを扱う企業内ソフトウェア開発者チームを統括した。同氏はスーパーファンド・キャピタル・マネジメント・インクの取締役であり、全米先物協会(NFA)にプリンシパルとして登録されている。ブリッグス氏は西インド諸島のグレナダ国籍を有する。

(後略)

4 利害関係人との取引制限

<訂正前>

(前略)

管理会社に支払われる報酬は、独立当事者間の交渉によって定められたものではない。ウルフ・メデック氏及びヨセフ・ホルツァー氏は、いずれも管理会社の取締役であり、マスターファンド及びアンダーライニング・マスターファンドの取締役でもある。

ウルフ・メデック氏及びヨセフ・ホルツァー氏は、投資顧問会社、販売会社並びにマスターファンド及びアンダーライニング・マスターファンドのマネジメント株式の株主と関係を有する。

(後略)

<訂正後>

(前略)

管理会社に支払われる報酬は、独立当事者間の交渉によって定められたものではない。テニソン・ブリッグス氏及びヨセフ・ホルツァー氏は、いずれも管理会社の取締役であり、マスターファンド及びアンダーライング・マスターファンドの取締役でもある。

テニソン・ブリッグス氏及びヨセフ・ホルツァー氏は、投資顧問会社、販売会社並びにマスターファンド及びアンダーライング・マスターファンドのマネジメント株式の株主と関係を有する。

(後略)