

## 【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3年9月30日                                                                                                                                                                                                               |
| 【発行者名】                                       | スーパーファンド・ジャパン・トレーディング<br>（ケイマン）リミテッド<br>（Superfund Japan Trading (Cayman) Limited）                                                                                                                                      |
| 【代表者の役職氏名】                                   | 取締役<br>テニソン・ブリッグス<br>（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、<br>クリケット・スクエア、ウィロー・ハウス4階、<br>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<br>（c/o Campbells Corporate Services Limited, Floor 4,<br>Willow House, Cricket Square, Grand Cayman, KY1-9010,<br>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<br>大手町パークビルディング<br>アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業                                                                                                                                                           |
| 【事務連絡者氏名】                                    | 弁護士 青 野 紘 子<br>弁護士 須 藤 綾 太<br>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<br>大手町パークビルディング<br>アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業                                                                                                                                                           |
| 【電話番号】                                       | 03（6775）1000                                                                                                                                                                                                            |
| 【届出の対象とした募集（売出）<br>外国投資信託受益証券に係る<br>ファンドの名称】 | スーパーファンド・ジャパン<br>（Superfund Japan）                                                                                                                                                                                      |
| 【届出の対象とした募集（売出）<br>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、4つの<br>サブファンドの各クラスにつき140億円、合計14,000億円を限度<br>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、2021年8月31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＝109.90円、1ユーロ＝129.69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６月30日に提出した有価証券届出書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】****第二部 ファンド情報****第1 ファンドの状況****5 運用状況****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****2 事業の内容及び営業の概況****3 管理会社の経理状況****3【訂正内容】**

訂正箇所は下線で示しています。

[次へ](#)

## 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

<訂正前>

（2021年3月31日現在）

|                  | 資産の種類                                                                 | 国 名    | 時価合計<br>円                            | 投資比率          |
|------------------|-----------------------------------------------------------------------|--------|--------------------------------------|---------------|
| グリーン（注1）<br>（注2） | スーパーファンド・グリーン・<br>ゴールドSPCの株式（クラスB）及び<br>スーパーファンド・グリーンSPCの株式<br>（クラスB） | ケイマン諸島 | <u>2,226,560,049</u>                 | <u>99.81%</u> |
|                  | 現金、受取債権及びその他の資産<br>（負債控除後）                                            | 該当なし   | <u>4,286,020</u>                     | <u>0.19%</u>  |
|                  | 純資産総額                                                                 |        | <u>2,230,846,069</u>                 | 100.00%       |
|                  |                                                                       |        |                                      |               |
|                  | 資産の種類                                                                 | 国 名    | 時価合計<br>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<br>（クラスC）                                         | ケイマン諸島 | <u>376,764,100</u>                   | <u>98.51%</u> |
|                  | 現金、受取債権及びその他の資産<br>（負債控除後）                                            | 該当なし   | <u>5,679,337</u>                     | <u>1.49%</u>  |
|                  | 純資産総額                                                                 |        | <u>382,443,437</u>                   | 100.00%       |
|                  |                                                                       |        |                                      |               |
|                  | 資産の種類                                                                 | 国 名    | 時価合計<br>米ドル<br>（円）                   | 投資比率          |
| レッド              | スーパーファンド・レッドワンSPCの株<br>式（クラス・ジャパン）                                    | ケイマン諸島 | <u>7,653,969.07</u><br>(840,099,645) | <u>99.45%</u> |
|                  | 現金、受取債権及びその他の資産<br>（負債控除後）                                            | 該当なし   | <u>42,057.05</u><br>(4,616,182)      | <u>0.55%</u>  |
|                  | 純資産総額                                                                 |        | <u>7,696,026.12</u><br>(844,715,827) | 100.00%       |
|                  |                                                                       |        |                                      |               |
|                  | 資産の種類                                                                 | 国 名    | 時価合計<br>円                            | 投資比率          |
| シャープパリティ<br>（注3） | スーパーファンドSPCの株式（分別ポー<br>トフォリオ・シャープパリティ・クラス<br>Bジャパン）                   | ケイマン諸島 | <u>237,469,392</u>                   | <u>97.25%</u> |
|                  | 現金、受取債権及びその他の資産<br>（負債控除後）                                            | 該当なし   | <u>6,714,491</u>                     | <u>2.75%</u>  |
|                  | 純資産総額                                                                 |        | <u>244,183,883</u>                   | 100.00%       |
|                  |                                                                       |        |                                      |               |

（中略）

（注3）サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システマティック・オールウェザー」と名称が変更される予定である。

## &lt;訂正後&gt;

(2021年6月30日現在)

| グリーン (注1)<br>(注2) | 資産の種類                                                                 | 国 名    | 時価合計<br>円                            | 投資比率          |
|-------------------|-----------------------------------------------------------------------|--------|--------------------------------------|---------------|
|                   | スーパーファンド・グリーン・<br>ゴールドSPCの株式（クラスB）及び<br>スーパーファンド・グリーンSPCの株式<br>（クラスB） | ケイマン諸島 | <u>2,087,300,007</u>                 | <u>99.88%</u> |
|                   | 現金、受取債権及びその他の資産<br>（負債控除後）                                            | 該当なし   | <u>2,482,441</u>                     | <u>0.12%</u>  |
|                   | 純資産総額                                                                 |        | <u>2,089,782,447</u>                 | 100.00%       |
| グリーンC             | 資産の種類                                                                 | 国 名    | 時価合計<br>円                            | 投資比率          |
|                   | スーパーファンド・グリーンSPCの株式<br>（クラスC）                                         | ケイマン諸島 | <u>386,939,192</u>                   | <u>98.66%</u> |
|                   | 現金、受取債権及びその他の資産<br>（負債控除後）                                            | 該当なし   | <u>5,247,634</u>                     | <u>1.34%</u>  |
|                   | 純資産総額                                                                 |        | <u>392,186,826</u>                   | 100.00%       |
| レッド               | 資産の種類                                                                 | 国 名    | 時価合計<br>米ドル<br>(円)                   | 投資比率          |
|                   | スーパーファンド・レッドワンSPCの株<br>式（クラス・ジャパン）                                    | ケイマン諸島 | <u>8,211,263.67</u><br>(902,417,877) | <u>99.54%</u> |
|                   | 現金、受取債権及びその他の資産<br>（負債控除後）                                            | 該当なし   | <u>37,666.76</u><br>(4,139,577)      | <u>0.46%</u>  |
|                   | 純資産総額                                                                 |        | <u>8,248,930.43</u><br>(906,557,454) | 100.00%       |
| シャープパリティ<br>(注3)  | 資産の種類                                                                 | 国 名    | 時価合計<br>円                            | 投資比率          |
|                   | スーパーファンドSPCの株式（分別ポ<br>ートフォリオ・シャープパリティ・クラス<br>B ジャパン）                  | ケイマン諸島 | <u>255,688,426</u>                   | <u>97.58%</u> |
|                   | 現金、受取債権及びその他の資産<br>（負債控除後）                                            | 該当なし   | <u>6,333,611</u>                     | <u>2.42%</u>  |
|                   | 純資産総額                                                                 |        | <u>262,022,037</u>                   | 100.00%       |

(中略)

(注3) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システマティック・オールウェザー」と名称が変更された。

**（２）投資資産****① 投資有価証券の主要銘柄**

&lt;訂正前&gt;

(2021年3月31日現在)

| サブ<br>ファンド           | 発行地        | 銘柄                                                                            | 業種                      | 数量           | 金額（簿価）                            |                         | 金額（時価）                            |                           | 投資<br>比率 |
|----------------------|------------|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|--------------|-----------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|---------------------------|----------|
| グリーン<br>(注1)<br>(注2) | ケイマン<br>諸島 | スーパーファンド・<br>グリーン・ゴールドSPCの<br>株式（クラスB）及び<br>スーパーファンド・グ<br>リーンSPCの株式（クラス<br>B） | 分別<br>ポート<br>フォリオ<br>会社 | 1,873,358.18 | 1,981,604,389円                    |                         | 2,226,560,044円                    |                           | 100%     |
|                      |            |                                                                               |                         |              | 単<br>価                            | 1,057.78円               | 単<br>価                            | 1,188.54円                 |          |
| グリーンC                | ケイマン<br>諸島 | スーパーファンド・<br>グリーンSPCの株式<br>（クラスC）                                             | 分別<br>ポート<br>フォリオ<br>会社 | 311,285.94   | 305,635,602円                      |                         | 376,764,100円                      |                           | 100%     |
|                      |            |                                                                               |                         |              | 単<br>価                            | 981.85円                 | 単<br>価                            | 1,210.35円                 |          |
| レッド                  | ケイマン<br>諸島 | スーパーファンド・<br>レッドワンSPCの株式<br>（クラス・ジャパン）                                        | 分別<br>ポート<br>フォリオ<br>会社 | 6,848.03     | 6,840,023.79米ドル<br>(750,761,011円) |                         | 7,653,969.08米ドル<br>(840,099,646円) |                           | 100%     |
|                      |            |                                                                               |                         |              | 単<br>価                            | 998.83米ドル<br>(109,632円) | 単<br>価                            | 1,117.69米ドル<br>(122,678円) |          |
| シャープ<br>パリティ<br>(注3) | ケイマン<br>諸島 | スーパーファンドSPCの株<br>式（分別ポートフォリ<br>オ・シャープパリティ・<br>クラスBジャパン）                       | 分別<br>ポート<br>フォリオ<br>会社 | 102,363.47   | 340,754,297円                      |                         | 237,469,395円                      |                           | 100%     |
|                      |            |                                                                               |                         |              | 単<br>価                            | 3,328.87円               | 単<br>価                            | 2,319.86円                 |          |

(中略)

(注3) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システムティック・オールウェザー」と名称が変更される予定である。

&lt;訂正後&gt;

(2021年6月30日現在)

| サブ<br>ファンド           | 発行地        | 銘柄                                                                        | 業種                      | 数量             | 金額（簿価）                            |                                 | 金額（時価）                            |                                 | 投資<br>比率 |
|----------------------|------------|---------------------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------|-----------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------|----------|
| グリーン<br>(注1)<br>(注2) | ケイマン<br>諸島 | スーパーファンド・グ<br>リーン・ゴールドSPCの株<br>式（クラスB）及びスー<br>パーファンド・グリー<br>ンSPCの株式（クラスB） | 分別<br>ポート<br>フォリオ<br>会社 | 1,684,538.7227 | 1,798,428,009円                    |                                 | 2,087,300,007円                    |                                 | 100%     |
|                      |            |                                                                           |                         |                | 単<br>価                            | 1067.6086円                      | 単<br>価                            | 1,239.0929円                     |          |
| グリーンC                | ケイマン<br>諸島 | スーパーファンド・グ<br>リーンSPCの株式（クラス<br>C）                                         | 分別<br>ポート<br>フォリオ<br>会社 | 310,856.2036   | 305,205,864円                      |                                 | 386,939,192円                      |                                 | 100%     |
|                      |            |                                                                           |                         |                | 単<br>価                            | 981.8233円                       | 単<br>価                            | 1,244.753円                      |          |
| レッド                  | ケイマン<br>諸島 | スーパーファンド・レ<br>ッドワンSPCの株式（クラ<br>ス・ジャパン）                                    | 分別<br>ポート<br>フォリオ<br>会社 | 6,880.9352     | 6,889,624.68米ドル<br>(757,169,752円) |                                 | 8,211,263.67米ドル<br>(902,417,877円) |                                 | 100%     |
|                      |            |                                                                           |                         |                | 単<br>価                            | 1,001.2628<br>米ドル<br>(110,039円) | 単<br>価                            | 1,193.3354<br>米ドル<br>(131,148円) |          |
| シャープ<br>パリティ<br>(注3) | ケイマン<br>諸島 | スーパーファンドSPCの株<br>式（分別ポートフォリ<br>オ・シャープパリティ・<br>クラスBジャパン）                   | 分別<br>ポート<br>フォリオ<br>会社 | 94,495.1952    | 330,821,686円                      |                                 | 255,688,426円                      |                                 | 100%     |
|                      |            |                                                                           |                         |                | 単<br>価                            | 3,500.9366円                     | 単<br>価                            | 2,705.8352円                     |          |

(中略)

(注3) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システムティック・オールウェザー」と名称が変更された。

**（３）運用実績**

&lt;訂正前&gt;

**① 純資産の推移****（a）純資産総額の推移**

## (中略)

|          | サブファンド<br>「グリーン」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(ゴールド円・<br>クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(ゴールド<br>米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「グリーンC」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「グリーンC」<br>(米ドル・<br>クラス) |
|----------|-----------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------------|------------------------------------|
|          | 純資産総額<br>(円)                | 純資産総額<br>(米ドル)                    | 純資産総額<br>(円)                        | 純資産総額<br>(米ドル)                            | 純資産総額<br>(円)                 | 純資産総額<br>(米ドル)                     |
| 2018年12月 | 571,375,492                 | 2,028,793.62                      | 339,227,272                         | 74,863.60                                 | 264,774,602                  | 1,317,843.39                       |
| 2019年12月 | 649,761,961                 | 1,917,820.80                      | 431,665,715                         | 112,628.46                                | 245,467,414                  | 1,467,651.12                       |
| 2020年4月  | 678,206,454                 | 1,939,703.00                      | 607,053,998                         | 135,613.86                                | 265,671,717                  | 1,578,745.76                       |
| 5月       | 670,818,013                 | 1,910,453.49                      | 842,807,790                         | 136,763.13                                | 261,351,311                  | 1,467,252.02                       |
| 6月       | 648,651,197                 | 1,852,560.96                      | 868,983,206                         | 136,763.13                                | 251,979,354                  | 1,416,068.81                       |
| 7月       | 678,771,166                 | 1,947,502.37                      | 973,998,326                         | 164,357.53                                | 270,091,824                  | 1,506,616.02                       |
| 8月       | 670,500,270                 | 1,909,123.80                      | 1,108,295,195                       | 211,045.19                                | 258,294,396                  | 1,473,503.58                       |
| 9月       | 615,739,946                 | 1,768,599.80                      | 990,575,524                         | 187,768.14                                | 236,520,233                  | 1,357,610.04                       |
| 10月      | 583,630,953                 | 1,712,749.28                      | 933,459,906                         | 178,457.33                                | 224,054,847                  | 1,291,385.16                       |
| 11月      | 574,594,770                 | 1,695,938.12                      | 950,999,429                         | 266,672.97                                | 224,248,109                  | 1,307,941.38                       |
| 12月      | 590,598,795                 | 1,759,940.16                      | 1,057,956,161                       | 296,303.30                                | 235,038,559                  | 1,374,166.26                       |
| 2021年1月  | 666,191,509                 | 1,866,792.85                      | 1,260,005,275                       | 291,364.91                                | 237,744,224                  | 1,374,166.26                       |
| 2月       | 709,358,481                 | 1,946,392.09                      | 1,281,372,038                       | 291,364.91                                | 251,692,530                  | 1,473,503.58                       |
| 3月       | 692,182,838                 | 1,835,025.28                      | 1,314,873,973                       | 188,500.77                                | 233,593,370                  | 1,349,097.69                       |

|          | サブファンド<br>「レッド」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(ゴールド<br>円・クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(ゴールド<br>米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(シルバー<br>円・クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(シルバー<br>米ドル・<br>クラス) |
|----------|----------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------|
|          | 純資産総額<br>(円)               | 純資産総額<br>(米ドル)                   | 純資産総額<br>(円)                       | 純資産総額<br>(米ドル)                           | 純資産総額<br>(円)                       | 純資産総額<br>(米ドル)                           |
| 2018年12月 | 186,320,367                | 181,711.07                       | 163,155,964                        | 362,379.15                               | 114,405,818                        | 4,574,903.92                             |
| 2019年12月 | 183,583,741                | 204,641.60                       | 191,078,019                        | 476,214.08                               | 109,588,466                        | 2,542,985.37                             |
| 2020年4月  | 147,101,333                | 182,622.07                       | 181,077,572                        | 459,570.24                               | 77,046,159                         | 1,830,333.31                             |
| 5月       | 142,023,368                | 177,689.34                       | 181,721,075                        | 458,178.62                               | 93,031,369                         | 2,196,853.03                             |
| 6月       | 140,610,167                | 182,577.63                       | 192,098,152                        | 483,617.52                               | 95,643,209                         | 2,256,656.00                             |
| 7月       | 140,613,514                | 187,399.26                       | 210,707,879                        | 540,729.81                               | 124,005,531                        | 2,983,805.74                             |
| 8月       | 132,830,893                | 181,88.83                        | 204,586,959                        | 524,642.63                               | 142,144,330                        | 3,417,830.55                             |
| 9月       | 130,511,742                | 179,444.68                       | 192,605,072                        | 495,919.49                               | 114,993,608                        | 2,776,307.74                             |
| 10月      | 124,047,240                | 171,890.05                       | 176,158,237                        | 471,148.56                               | 109,962,903                        | 2,675,730.01                             |
| 11月      | 131,845,441                | 183,310.88                       | 177,224,344                        | 475,045.11                               | 111,516,305                        | 2,720,129.18                             |
| 12月      | 133,486,916                | 187,488.14                       | 190,859,484                        | 516,292.88                               | 131,703,402                        | 3,242,499.10                             |
| 2021年1月  | 134,823,153                | 186,777.12                       | 184,616,995                        | 502,098.30                               | 137,917,686                        | 3,298,677.66                             |
| 2月       | 137,174,261                | 186,666.02                       | 175,529,002                        | 468,420.98                               | 140,495,886                        | 3,226,642.25                             |
| 3月       | 140,916,561                | 184,577.39                       | 177,424,982                        | 458,846.60                               | 134,856,892                        | 2,959,341.08                             |

|          | サブファンド<br>「シャープパ<br>リティ」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「シャープパ<br>リティ」<br>(ゴールド<br>円・クラス) |
|----------|-------------------------------------|---------------------------------------------|
|          | 純資産総額<br>(円)                        | 純資産総額<br>(円)                                |
| 2018年12月 | 107,994,977                         | 218,335,809                                 |
| 2019年12月 | 77,319,294                          | 175,257,399                                 |
| 2020年4月  | 61,929,430                          | 158,254,274                                 |
| 5月       | 62,874,285                          | 164,770,283                                 |
| 6月       | 63,669,952                          | 171,169,413                                 |
| 7月       | 67,958,531                          | 194,954,305                                 |
| 8月       | 69,512,057                          | 198,979,603                                 |
| 9月       | 66,586,800                          | 182,321,765                                 |
| 10月      | 64,421,778                          | 173,709,288                                 |
| 11月      | 68,603,079                          | 174,877,082                                 |
| 12月      | 66,812,165                          | 189,205,761                                 |
| 2021年1月  | 65,663,176                          | 184,041,120                                 |
| 2月       | 65,414,745                          | 173,827,897                                 |
| 3月       | 63,958,906                          | 180,211,161                                 |

(中略)

(注7) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システムティック・オールウェザー」と名称が変更される予定である。

## &lt;訂正後&gt;

## ① 純資産の推移

## (a) 純資産総額の推移

(中略)

|          | サブファンド<br>「グリーン」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(ゴールド<br>円・クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(ゴールド<br>米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「グリーンC」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「グリーンC」<br>(米ドル・<br>クラス) |
|----------|-----------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------------|------------------------------------|
|          | 純資産総額<br>(円)                | 純資産総額<br>(米ドル)                    | 純資産総額<br>(円)                        | 純資産総額<br>(米ドル)                            | 純資産総額<br>(円)                 | 純資産総額<br>(米ドル)                     |
| 2018年12月 | 571,375,492                 | 2,028,793.62                      | 339,227,272                         | 74,863.60                                 | 264,774,602                  | 1,317,843.39                       |
| 2019年12月 | 649,761,961                 | 1,917,820.80                      | 431,665,715                         | 112,628.46                                | 245,467,414                  | 1,467,651.12                       |
| 2020年8月  | 670,500,270                 | 1,909,123.80                      | 1,108,295,195                       | 211,045.19                                | 258,294,396                  | 1,473,503.58                       |
| 9月       | 615,739,946                 | 1,768,599.80                      | 990,575,524                         | 187,768.14                                | 236,520,233                  | 1,357,610.04                       |
| 10月      | 583,630,953                 | 1,712,749.28                      | 933,459,906                         | 178,457.33                                | 224,054,847                  | 1,291,385.16                       |
| 11月      | 574,594,770                 | 1,695,938.12                      | 950,999,429                         | 266,672.97                                | 224,248,109                  | 1,307,941.38                       |
| 12月      | 590,598,795                 | 1,759,940.16                      | 1,057,956,161                       | 296,303.30                                | 235,038,559                  | 1,374,166.26                       |
| 2021年1月  | 666,191,509                 | 1,866,792.85                      | 1,260,005,275                       | 291,364.91                                | 237,744,224                  | 1,374,166.26                       |
| 2月       | 709,358,481                 | 1,946,392.09                      | 1,281,372,038                       | 291,364.91                                | 251,692,530                  | 1,473,503.58                       |
| 3月       | 692,182,838                 | 1,835,025.28                      | 1,314,873,973                       | 188,500.77                                | 233,593,370                  | 1,349,097.69                       |
| 4月       | 683,034,510                 | 1,872,096.49                      | 1,344,632,690                       | 194,890.63                                | 236,635,623                  | 1,380,111.43                       |
| 5月       | 705,863,169                 | 1,927,703.32                      | 1,383,825,943                       | 275,197.59                                | 248,345,427                  | 1,442,138.91                       |
| 6月       | 678,296,029                 | 1,807,787.89                      | 1,181,772,070                       | 251,267.37                                | 239,534,373                  | 1,380,111.43                       |
| 7月       | 688,665,040                 | 1,880,099.40                      | 1,230,775,797                       | 263,232.48                                | 247,513,112                  | 1,442,138.91                       |

|           | サブファンド<br>「レッド」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(ゴールド円・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(ゴールド<br>米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(シルバー円・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(シルバー<br>米ドル・<br>クラス) |
|-----------|----------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------|
|           | 純資産総額<br>(円)               | 純資産総額<br>(米ドル)                   | 純資産総額<br>(円)                       | 純資産総額<br>(米ドル)                           | 純資産総額<br>(円)                       | 純資産総額<br>(米ドル)                           |
| 2018年12月  | 186,320,367                | 181,711.07                       | 163,155,964                        | 362,379.15                               | 114,405,818                        | 4,574,903.92                             |
| 2019年12月  | 183,583,741                | 204,641.60                       | 191,078,019                        | 476,214.08                               | 109,588,466                        | 2,542,985.37                             |
| 2020年 8 月 | 132,830,893                | 181,88.83                        | 204,586,959                        | 524,642.63                               | 142,144,330                        | 3,417,830.55                             |
| 9 月       | 130,511,742                | 179,444.68                       | 192,605,072                        | 495,919.49                               | 114,993,608                        | 2,776,307.74                             |
| 10月       | 124,047,240                | 171,890.05                       | 176,158,237                        | 471,148.56                               | 109,962,903                        | 2,675,730.01                             |
| 11月       | 131,845,441                | 183,310.88                       | 177,224,344                        | 475,045.11                               | 111,516,305                        | 2,720,129.18                             |
| 12月       | 133,486,916                | 187,488.14                       | 190,859,484                        | 516,292.88                               | 131,703,402                        | 3,242,499.10                             |
| 2021年 1 月 | 134,823,153                | 186,777.12                       | 184,616,995                        | 502,098.30                               | 137,917,686                        | 3,298,677.66                             |
| 2 月       | 137,174,261                | 186,666.02                       | 175,529,002                        | 468,420.98                               | 140,495,886                        | 3,226,642.25                             |
| 3 月       | 140,916,561                | 184,577.39                       | 177,424,982                        | 458,846.60                               | 134,856,892                        | 2,959,341.08                             |
| 4 月       | 142,359,712                | 188,815.97                       | 184,816,509                        | 483,430.50                               | 143,608,519                        | 3,294,204.85                             |
| 5 月       | 144,031,565                | 190,155.15                       | 201,303,913                        | 523,568.36                               | 157,419,295                        | 3,589,394.82                             |
| 6 月       | 139,410,016                | 188,261.55                       | 187,730,251                        | 482,226.77                               | 146,356,709                        | 3,316,926.71                             |
| 7 月       | 137,637,935                | 193,503.27                       | 194,528,577                        | 506,805.04                               | 148,214,543                        | 3,345,546.23                             |

|           | サブファンド<br>「システムティッ<br>ク・オールウェ<br>ザー」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「システムティッ<br>ク・オールウェ<br>ザー」<br>(ゴールド円・<br>クラス) |
|-----------|-------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|           | 純資産総額<br>(円)                                    | 純資産総額<br>(円)                                            |
| 2018年12月  | 107,994,977                                     | 218,335,809                                             |
| 2019年12月  | 77,319,294                                      | 175,257,399                                             |
| 2020年 8 月 | 69,512,057                                      | 198,979,603                                             |
| 9 月       | 66,586,800                                      | 182,321,765                                             |
| 10月       | 64,421,778                                      | 173,709,288                                             |
| 11月       | 68,603,079                                      | 174,877,082                                             |
| 12月       | 66,812,165                                      | 189,205,761                                             |
| 2021年 1 月 | 65,663,176                                      | 184,041,120                                             |
| 2 月       | 65,414,745                                      | 173,827,897                                             |
| 3 月       | 63,958,906                                      | 180,211,161                                             |
| 4 月       | 60,467,114                                      | 187,580,930                                             |
| 5 月       | 61,162,458                                      | 205,541,115                                             |
| 6 月       | 63,206,770                                      | 198,805,434                                             |
| 7 月       | 66,769,721                                      | 213,740,010                                             |

(中略)

(注7) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システムティック・オールウェザー」と名称が変更された。



## &lt;訂正前&gt;

## (b) 1口当たりの純資産価額の推移

(中略)

|          | サブファンド<br>「グリーン」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(ゴールド円・<br>クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(ゴールド<br>米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「グリーンC」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「グリーンC」<br>(米ドル・<br>クラス) |
|----------|-----------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------------|------------------------------------|
|          | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)      | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル)          | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)              | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル)                  | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)       | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル)           |
| 2018年12月 | 58.31                       | 0.74                              | 74.42                               | 0.70                                      | 56.44                        | 0.61                               |
| 2019年12月 | 70.59                       | 0.90                              | 102.38                              | 0.98                                      | 71.63                        | 0.78                               |
| 2020年4月  | 77.51                       | 1.00                              | 121.86                              | 1.18                                      | 79.94                        | 0.88                               |
| 5月       | 76.69                       | 0.99                              | 123.75                              | 1.19                                      | 78.64                        | 0.86                               |
| 6月       | 74.58                       | 0.96                              | 123.74                              | 1.19                                      | 75.82                        | 0.83                               |
| 7月       | 78.32                       | 1.03                              | 140.01                              | 1.37                                      | 81.27                        | 0.91                               |
| 8月       | 77.52                       | 1.02                              | 138.35                              | 1.36                                      | 80.19                        | 0.89                               |
| 9月       | 72.39                       | 0.95                              | 122.99                              | 1.21                                      | 73.43                        | 0.82                               |
| 10月      | 69.33                       | 0.92                              | 115.55                              | 1.15                                      | 69.56                        | 0.78                               |
| 11月      | 69.27                       | 0.92                              | 108.75                              | 1.08                                      | 69.62                        | 0.79                               |
| 12月      | 71.56                       | 0.96                              | 118.95                              | 1.20                                      | 72.97                        | 0.83                               |
| 2021年1月  | 72.36                       | 0.96                              | 118.96                              | 1.18                                      | 73.81                        | 0.83                               |
| 2月       | 77.50                       | 1.01                              | 120.71                              | 1.18                                      | 80.29                        | 0.89                               |
| 3月       | 78.93                       | 0.99                              | 125.26                              | 1.18                                      | 81.39                        | 0.87                               |

|          | サブファンド<br>「レッド」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(ゴールド<br>円・クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(ゴールド<br>米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(シルバー円・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(シルバー<br>米ドル・<br>クラス) |
|----------|----------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------|
|          | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)     | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル)         | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)             | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル)                 | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)             | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル)                 |
| 2018年12月 | 92.0331                    | 0.8178                           | 73.2756                            | 0.6510                                   | 50.1816                            | 0.4458                                   |
| 2019年12月 | 102.6311                   | 0.9210                           | 95.3368                            | 0.8555                                   | 62.5566                            | 0.5613                                   |
| 2020年4月  | 90.3829                    | 0.8219                           | 90.8002                            | 0.8256                                   | 44.4370                            | 0.4040                                   |
| 5月       | 88.4700                    | 0.7997                           | 91.0726                            | 0.8231                                   | 53.6566                            | 0.4849                                   |
| 6月       | 90.9905                    | 0.8217                           | 96.2203                            | 0.8688                                   | 55.1630                            | 0.4981                                   |
| 7月       | 91.5728                    | 0.8434                           | 105.4868                           | 0.9714                                   | 71.5212                            | 0.6586                                   |
| 8月       | 88.9491                    | 0.8186                           | 102.4225                           | 0.9425                                   | 81.9829                            | 0.7544                                   |
| 9月       | 87.3961                    | 0.8076                           | 96.4240                            | 0.8909                                   | 66.3235                            | 0.6128                                   |
| 10月      | 83.0672                    | 0.7736                           | 90.8968                            | 0.8464                                   | 63.4220                            | 0.5906                                   |
| 11月      | 88.2892                    | 0.8250                           | 91.3432                            | 0.8534                                   | 64.2595                            | 0.6004                                   |
| 12月      | 89.3884                    | 0.8438                           | 98.2600                            | 0.9275                                   | 75.8240                            | 0.7157                                   |
| 2021年1月  | 90.2832                    | 0.8406                           | 96.8917                            | 0.9020                                   | 78.2052                            | 0.7281                                   |
| 2月       | 91.8576                    | 0.8401                           | 92.0224                            | 0.8415                                   | 77.8848                            | 0.7122                                   |
| 3月       | 94.3636                    | 0.8307                           | 93.6461                            | 0.8243                                   | 74.2138                            | 0.6532                                   |

|          | サブファンド<br>「シャープ<br>パリティ」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「シャープ<br>パリティ」<br>(ゴールド円・<br>クラス) |
|----------|-------------------------------------|---------------------------------------------|
|          | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)              | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)                      |
| 2018年12月 | 53.57                               | 64.43                                       |
| 2019年12月 | 41.66                               | 59.01                                       |
| 2020年4月  | 37.36                               | 54.16                                       |
| 5月       | 37.93                               | 56.39                                       |
| 6月       | 38.41                               | 58.58                                       |
| 7月       | 41.12                               | 66.72                                       |
| 8月       | 42.06                               | 68.19                                       |
| 9月       | 40.29                               | 62.45                                       |
| 10月      | 38.98                               | 59.50                                       |
| 11月      | 41.51                               | 59.90                                       |
| 12月      | 43.03                               | 65.21                                       |
| 2021年1月  | 42.29                               | 63.43                                       |
| 2月       | 42.13                               | 59.91                                       |
| 3月       | 42.45                               | 62.11                                       |

(中略)

(注7) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システムティック・オールウェザー」と名称が変更される予定である。

&lt;訂正後&gt;

(b) 1口当たりの純資産価額の推移

(中略)

|          | サブファンド<br>「グリーン」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(ゴールド円・<br>クラス) | サブファンド<br>「グリーン」<br>(ゴールド<br>米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「グリーンC」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「グリーンC」<br>(米ドル・<br>クラス) |
|----------|-----------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------------|------------------------------------|
|          | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)      | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル)          | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)              | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル)                  | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)       | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル)           |
| 2018年12月 | 58.31                       | 0.74                              | 74.42                               | 0.70                                      | 56.44                        | 0.61                               |
| 2019年12月 | 70.59                       | 0.90                              | 102.38                              | 0.98                                      | 71.63                        | 0.78                               |
| 2020年8月  | 77.52                       | 1.02                              | 138.35                              | 1.36                                      | 80.19                        | 0.89                               |
| 9月       | 72.39                       | 0.95                              | 122.99                              | 1.21                                      | 73.43                        | 0.82                               |
| 10月      | 69.33                       | 0.92                              | 115.55                              | 1.15                                      | 69.56                        | 0.78                               |
| 11月      | 69.27                       | 0.92                              | 108.75                              | 1.08                                      | 69.62                        | 0.79                               |
| 12月      | 71.56                       | 0.96                              | 118.95                              | 1.20                                      | 72.97                        | 0.83                               |
| 2021年1月  | 72.36                       | 0.96                              | 118.96                              | 1.18                                      | 73.81                        | 0.83                               |
| 2月       | 77.50                       | 1.01                              | 120.71                              | 1.18                                      | 80.29                        | 0.89                               |
| 3月       | 78.93                       | 0.99                              | 125.26                              | 1.18                                      | 81.39                        | 0.87                               |
| 4月       | 79.42                       | 1.01                              | 128.27                              | 1.22                                      | 82.45                        | 0.89                               |
| 5月       | 82.50                       | 1.04                              | 144.93                              | 1.38                                      | 86.53                        | 0.93                               |
| 6月       | 80.46                       | 1.00                              | 133.19                              | 1.26                                      | 83.46                        | 0.89                               |
| 7月       | 82.23                       | 1.04                              | 137.95                              | 1.32                                      | 86.24                        | 0.93                               |

|  | サブファンド<br>「レッド」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(ゴールド円・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(ゴールド<br>米ドル・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(シルバー円・<br>クラス) | サブファンド<br>「レッド」<br>(シルバー<br>米ドル・<br>クラス) |
|--|----------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------|
|--|----------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------|

|          | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル) | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル) | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(米ドル) |
|----------|------------------------|--------------------------|------------------------|--------------------------|------------------------|--------------------------|
| 2018年12月 | 92.0331                | 0.8178                   | 73.2756                | 0.6510                   | 50.1816                | 0.4458                   |
| 2019年12月 | 102.6311               | 0.9210                   | 95.3368                | 0.8555                   | 62.5566                | 0.5613                   |
| 2020年8月  | 88.9491                | 0.8186                   | 102.4225               | 0.9425                   | 81.9829                | 0.7544                   |
| 9月       | 87.3961                | 0.8076                   | 96.4240                | 0.8909                   | 66.3235                | 0.6128                   |
| 10月      | 83.0672                | 0.7736                   | 90.8968                | 0.8464                   | 63.4220                | 0.5906                   |
| 11月      | 88.2892                | 0.8250                   | 91.3432                | 0.8534                   | 64.2595                | 0.6004                   |
| 12月      | 89.3884                | 0.8438                   | 98.2600                | 0.9275                   | 75.8240                | 0.7157                   |
| 2021年1月  | 90.2832                | 0.8406                   | 96.8917                | 0.9020                   | 78.2052                | 0.7281                   |
| 2月       | 91.8576                | 0.8401                   | 92.0224                | 0.8415                   | 77.8848                | 0.7122                   |
| 3月       | 94.3636                | 0.8307                   | 93.6461                | 0.8243                   | 74.2138                | 0.6532                   |
| 4月       | 95.3300                | 0.8498                   | 97.4376                | 0.8498                   | 78.9129                | 0.7033                   |
| 5月       | 96.4495                | 0.8558                   | 106.0152               | 0.9406                   | 86.3816                | 0.7664                   |
| 6月       | 96.5887                | 0.8473                   | 98.7686                | 0.8663                   | 80.7438                | 0.7082                   |
| 7月       | 98.0093                | 0.8709                   | 102.4761               | 0.9105                   | 79.9657                | 0.7105                   |

|          | サブファンド<br>「システムティッ<br>ク・オールウェ<br>ザー」<br>(円・クラス) | サブファンド<br>「システムティッ<br>ク・オールウェ<br>ザー」<br>(ゴールド円・<br>クラス) |
|----------|-------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|          | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)                          | 1口当たりの<br>純資産価額<br>(円)                                  |
| 2018年12月 | 53.57                                           | 64.43                                                   |
| 2019年12月 | 41.66                                           | 59.01                                                   |
| 2020年8月  | 42.06                                           | 68.19                                                   |
| 9月       | 40.29                                           | 62.45                                                   |
| 10月      | 38.98                                           | 59.50                                                   |
| 11月      | 41.51                                           | 59.90                                                   |
| 12月      | 43.03                                           | 65.21                                                   |
| 2021年1月  | 42.29                                           | 63.43                                                   |
| 2月       | 42.13                                           | 59.91                                                   |
| 3月       | 42.45                                           | 62.11                                                   |
| 4月       | 43.48                                           | 64.65                                                   |
| 5月       | 43.98                                           | 70.84                                                   |
| 6月       | 45.45                                           | 68.71                                                   |
| 7月       | 46.55                                           | 71.06                                                   |

(中略)

(注7) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システムティック・オールウェザー」と名称が変更された。

## &lt;訂正前&gt;

## ③ 収益率の推移

(中略)

## サブファンド「グリーンB」

|                                    | 収益率     |         |           |             |
|------------------------------------|---------|---------|-----------|-------------|
|                                    | 円・クラス   | 米ドル・クラス | ゴールド円・クラス | ゴールド米ドル・クラス |
| 自2018年<br>1月1日<br>至2018年<br>12月31日 | －25.95% | －13.95% | －27.99%   | －26.32%     |
| 自2019年<br>1月1日<br>至2019年<br>12月31日 | 21.06%  | 21.62%  | 37.57%    | 40.00%      |
| 自2020年<br>1月1日<br>至2020年<br>12月31日 | 1.37%   | 6.67%   | 16.18%    | 22.45%      |

## サブファンド「グリーンC」

|                                    | 収益率     |         |
|------------------------------------|---------|---------|
|                                    | 円・クラス   | 米ドル・クラス |
| 自2018年<br>1月1日<br>至2018年<br>12月31日 | －28.98% | －26.61% |
| 自2019年<br>1月1日<br>至2019年<br>12月31日 | 26.91%  | 27.87%  |
| 自2020年<br>1月1日<br>至2020年<br>12月31日 | 1.87%   | 6.41%   |

## サブファンド「レッド」

|                                    | 収益率     |         |           |             |           |             |
|------------------------------------|---------|---------|-----------|-------------|-----------|-------------|
|                                    | 円・クラス   | 米ドル・クラス | ゴールド円・クラス | ゴールド米ドル・クラス | シルバー円・クラス | シルバー米ドル・クラス |
| 自2018年<br>1月1日<br>至2018年<br>12月31日 | －12.89% | －10.51% | －17.03%   | －14.77%     | －23.81%   | －21.73%     |
| 自2019年<br>1月1日<br>至2019年<br>12月31日 | 11.52%  | 12.62%  | 30.11%    | 31.41%      | 24.66%    | 25.91%      |
| 自2020年<br>1月1日<br>至2020年<br>12月31日 | －12.90% | －8.38%  | 3.07%     | 8.42%       | 21.21%    | 27.51%      |

## サブファンド「シャープパリティ」

|                                    | 収益率     |           |
|------------------------------------|---------|-----------|
|                                    | 円・クラス   | ゴールド円・クラス |
| 自2018年<br>1月1日<br>至2018年<br>12月31日 | －27.45% | －30.85%   |
| 自2019年<br>1月1日<br>至2019年<br>12月31日 | －22.23% | －8.41%    |
| 自2020年<br>1月1日<br>至2020年<br>12月31日 | 3.29%   | 10.51%    |

(中略)

(注7) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システムティック・オールウェザー」と名称が変更される予定である。

&lt;訂正後&gt;

## ③ 収益率の推移

(中略)

## サブファンド「グリーン」

|                                    | 収益率     |         |           |             |
|------------------------------------|---------|---------|-----------|-------------|
|                                    | 円・クラス   | 米ドル・クラス | ゴールド円・クラス | ゴールド米ドル・クラス |
| 自2018年<br>1月1日<br>至2018年<br>12月31日 | －25.95% | －13.95% | －27.99%   | －26.32%     |
| 自2019年<br>1月1日<br>至2019年<br>12月31日 | 21.06%  | 21.62%  | 37.57%    | 40.00%      |
| 自2020年<br>1月1日<br>至2020年<br>12月31日 | 1.37%   | 6.67%   | 16.18%    | 22.45%      |
| 自2020年<br>8月1日<br>至2021年<br>7月31日  | 4.99%   | 0.97%   | －1.47%    | －3.65%      |

## サブファンド「グリーンC」

|                                    | 収益率     |         |
|------------------------------------|---------|---------|
|                                    | 円・クラス   | 米ドル・クラス |
| 自2018年<br>1月1日<br>至2018年<br>12月31日 | －28.98% | －26.61% |
| 自2019年<br>1月1日<br>至2019年<br>12月31日 | 26.91%  | 27.87%  |

|                                    |       |       |
|------------------------------------|-------|-------|
| 自2020年<br>1月1日<br>至2020年<br>12月31日 | 1.87% | 6.41% |
| 自2020年<br>8月1日<br>至2021年<br>7月31日  | 6.12% | 2.20% |

## サブファンド「レッド」

|                                    | 収益率     |         |           |             |           |             |
|------------------------------------|---------|---------|-----------|-------------|-----------|-------------|
|                                    | 円・クラス   | 米ドル・クラス | ゴールド円・クラス | ゴールド米ドル・クラス | シルバー円・クラス | シルバー米ドル・クラス |
| 自2018年<br>1月1日<br>至2018年<br>12月31日 | －12.89% | －10.51% | －17.03%   | －14.77%     | －23.81%   | －21.73%     |
| 自2019年<br>1月1日<br>至2019年<br>12月31日 | 11.52%  | 12.62%  | 30.11%    | 31.41%      | 24.66%    | 25.91%      |
| 自2020年<br>1月1日<br>至2020年<br>12月31日 | －12.90% | －8.38%  | 3.07%     | 8.42%       | 21.21%    | 27.51%      |
| 自2020年<br>8月1日<br>至2021年<br>7月31日  | 7.03%   | 3.26%   | －2.85%    | －6.27%      | 11.81%    | 7.88%       |

## サブファンド「システマティック・オールウェザー」

|                                    | 収益率     |           |
|------------------------------------|---------|-----------|
|                                    | 円・クラス   | ゴールド円・クラス |
| 自2018年<br>1月1日<br>至2018年<br>12月31日 | －27.45% | －30.85%   |
| 自2019年<br>1月1日<br>至2019年<br>12月31日 | －22.23% | －8.41%    |
| 自2020年<br>1月1日<br>至2020年<br>12月31日 | 3.29%   | 10.51%    |
| 自2020年<br>8月1日<br>至2021年<br>7月31日  | 13.21%  | 6.50%     |

(中略)

(注7) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システマティック・オールウェザー」と名称が変更された。

## (4) 販売及び買戻しの実績

以下が「(4) 販売及び買戻しの実績」の終わりに追加挿入される。

(自2020年8月1日至2021年7月31日)

| サブ<br>ファンド                   | クラス             | 販売受益証券数<br>(口)                 | 買戻受益証券数<br>(口)           | 発行済受益証券数<br>(口)                    |
|------------------------------|-----------------|--------------------------------|--------------------------|------------------------------------|
| グリーン                         | 円・クラス           | 1,020,402<br>(1,020,402)       | 1,312,178<br>(1,312,178) | 8,374,864<br>(8,374,864)           |
|                              | 米ドル・クラス         | 114,430<br>(114,430)           | 197,421<br>(197,421)     | 1,807,788<br>(1,807,788)           |
|                              | ゴールド円・クラス       | 4,359,875<br>(4,359,875)       | 2,394,611<br>(2,394,611) | 8,921,898<br>(8,921,898)           |
|                              | ゴールド米ドル<br>・クラス | 166,623<br>(166,623)           | 87,173<br>(87,173)       | 199,419<br>(199,419)               |
| グリーンC                        | 円・クラス           | -<br>(-)                       | 453,339<br>(453,339)     | 2,870,050<br>(2,870,050)           |
|                              | 米ドル・クラス         | -<br>(-)                       | 104,935<br>(104,935)     | 1,550,687<br>(1,550,687)           |
| レッド                          | 円・クラス           | -<br>(-)                       | 131,202<br>(131,202)     | 1,404,336<br>(1,404,336)           |
|                              | 米ドル・クラス         | -<br>(-)                       | -<br>(-)                 | 222,195<br>(222,195)               |
|                              | ゴールド円・クラス       | 39,560.49<br>(39,560.49)       | 138,758<br>(138,758)     | 1,898,283.115<br>(1,898,283.115)   |
|                              | ゴールド米ドル<br>・クラス | -<br>(-)                       | -<br>(-)                 | 556,650<br>(556,650)               |
|                              | シルバー円・クラス       | 146,726.04<br>(146,726.04)     | 27,078<br>(27,078)       | 1,853,477.044<br>(1,853,477.044)   |
|                              | シルバー米ドル<br>・クラス | 178,509.0169<br>(178,509.0169) | -<br>(-)                 | 4,709,037.3112<br>(414,743.0169)   |
| システム<br>ティック・<br>オールウェ<br>ザー | 円・クラス           | 43,677.66<br>(43,677.66)       | 262,000<br>(262,000)     | 1,434,365.6588<br>(1,434,365.6588) |
|                              | ゴールド円・クラス       | 115,948.46<br>(115,948.46)     | 30,045<br>(30,045)       | 3,007,880.804<br>(3,007,880.804)   |

(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、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た。2021年1月1日付で、サブファンド「グリーンA」は終了した。

(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」と名称が変更された。

(注3) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システムティック・オールウェザー」と名称が変更された。

[次へ](#)

### 第3 ファンドの経理状況

#### 1 財務諸表

##### （1）貸借対照表

以下が「第3 ファンドの経理状況、1 財務諸表、（1）貸借対照表」の終わりに追加挿入される。

1. 本書記載のスーパーファンド・ジャパン（以下、「当ファンド」という。）の2021年6月30日に終了した6ヶ月に係る和文の中間財務書類は、「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」（平成5年大蔵省令第22号）に基づき、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第76条第4項ただし書の規定を適用して、米国における諸法令及び一般に認められた会計原則に準拠して作成された当ファンドの中間財務書類の原文を翻訳したものである。
2. 当ファンドの原文の中間財務書類は、独立監査人の監査を受けていない。
3. 当ファンドの原文の中間財務書類は、一部米ドルで表示されている。日本文の中間財務書類には、原文の中間財務書類中の米ドル表示の金額のうち主要なものについて円換算額が併記されている。日本円への換算には、2021年8月31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＝109.90円）が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。



**（１）資産及び負債の状況**

スーパーファンド・ジャパンースーパーファンド・グリーン・ジャパン（旧称：「スーパーファンド・グリーンB・ジャパン」）

貸借対照表（未監査）

2021年及び2020年 6 月30日現在

（単位：日本円）

|                                      | 注記    | 2021年                       | 2020年                       |
|--------------------------------------|-------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>資産</b>                            |       |                             |                             |
| ファンドの投資（公正価値）<br>（原価：1,799,507,371円） |       | 2,087,225,869               | 1,730,809,497               |
| ファンドへの投資に関する未収金                      |       | 4,607,525                   | 1,490,193                   |
| 現金                                   |       | 4,578,680                   | 2,190,000                   |
| 外貨建て現金（原価：2,296,951円）                |       | 3,753,390                   | 3,477,139                   |
| その他の資産                               |       | 728,659                     | 492,221                     |
|                                      |       | <u>2,100,894,123</u>        | <u>1,738,459,050</u>        |
| <b>負債</b>                            |       |                             |                             |
| 前受申込金                                |       | 3,190,000                   | 2,837,580                   |
| 未払買戻金                                |       | 8,642,563                   | 648,976                     |
| 未払金及び未払費用                            | 3,4,6 | 3,379,756                   | 2,940,950                   |
|                                      |       | <u>15,212,319</u>           | <u>6,427,506</u>            |
| <b>純資産</b>                           |       | <u><u>2,085,681,804</u></u> | <u><u>1,732,031,544</u></u> |

添付の財務諸表注記参照。

スーパーファンド・ジャパンースーパーファンド・グリーン・ジャパン（旧称：「スーパーファンド・グリーンB・ジャパン」）

損益計算書（未監査）

2021年1月1日から2021年6月30日の期間（及び2020年1月1日から2020年6月30日の期間）

（単位：日本円）

|                                     | 注記 | 2021年6月30日に<br>終了した6ヶ月 | 2020年6月30日に<br>終了した6ヶ月 |
|-------------------------------------|----|------------------------|------------------------|
| <b>収益</b>                           |    |                        |                        |
| その他の収益                              |    | —                      | —                      |
|                                     |    | —                      | —                      |
| <b>費用</b>                           |    |                        |                        |
| 事務管理報酬                              | 6  | 661,801                | 658,116                |
| 専門家報酬                               |    | 1,409,030              | —                      |
| 受託会社報酬                              | 5  | 588,811                | 456,987                |
| 代行協会員報酬                             | 4  | 1,110,188              | 750,817                |
| 管理報酬                                | 3  | 1,110,113              | 750,763                |
| 支払利息                                |    | —                      | 36,347                 |
| 一般管理費                               |    | 4,039,717              | 4,100,680              |
|                                     |    | 8,919,660              | 6,753,710              |
| <b>正味投資損失</b>                       |    | (8,919,660)            | (6,753,710)            |
| <b>投資及び外貨に係る正味実現及び<br/>未実現利益の変動</b> |    |                        |                        |
| 投資及び外貨に係る正味実現利益                     |    | 83,181,531             | 9,594,839              |
| 投資及び外貨に係る未実現利益の変動                   |    | 193,596,333            | 144,476,221            |
|                                     |    | 276,777,864            | 154,071,060            |
| <b>営業活動から生じた純資産の正味増加額</b>           |    | 267,858,204            | 147,317,350            |

添付の財務諸表注記参照。

スーパーファンド・ジャパンースーパーファンド・グリーン・ジャパン（旧称：「スーパーファンド・グリーンB・ジャパン」）

純資産変動計算書（未監査）

2021年1月1日から2021年6月30日の期間（及び2020年1月1日から2020年6月30日の期間）

（単位：日本円）

|                          | 2021年                       | 2020年                       |
|--------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>営業活動</b>              |                             |                             |
| 正味投資損失                   | (8,919,660)                 | (6,753,710)                 |
| 投資及び外貨に係る正味実現利益          | 83,181,531                  | 9,594,839                   |
| 投資及び外貨に係る未実現利益の変動        | 193,596,333                 | 144,476,221                 |
|                          | <u>267,858,204</u>          | <u>147,317,350</u>          |
| <b>資本取引</b>              |                             |                             |
| ゴールド円・クラス受益証券の発行に係る収入    | 255,359,008                 | 355,370,000                 |
| 円・クラス受益証券の発行に係る収入        | 70,351,054                  | 6,700,000                   |
| ゴールド米ドル・クラス受益証券の発行に係る収入  | 5,293,835                   | —                           |
| 米ドル・クラス受益証券の発行に係る収入      | 11,346,103                  | —                           |
| ゴールド円・クラス受益証券の買戻しに係る支払   | (291,647,335)               | (12,783,528)                |
| 円・クラス受益証券の買戻しに係る支払       | (67,702,609)                | (40,985,103)                |
| ゴールド米ドル・クラス受益証券の買戻しに係る支払 | (10,978,264)                | —                           |
| 米ドル・クラス受益証券の買戻しに係る支払     | (15,007,296)                | (21,323,920)                |
|                          | <u>(42,985,504)</u>         | <u>286,977,449</u>          |
| <b>当期純資産増加額</b>          | <u>224,872,700</u>          | <u>434,294,799</u>          |
| <b>期首純資産残高</b>           | <u>1,860,809,104</u>        | <u>1,297,736,745</u>        |
| <b>期末純資産残高</b>           | <u><u>2,085,681,804</u></u> | <u><u>1,732,031,544</u></u> |

添付の財務諸表注記参照。

## スーパーファンド・ジャパンスーパーファンド・グリーンCジャパン

## 貸借対照表（未監査）

2021年及び2020年 6 月30日現在

（単位：日本円）

|                | 注記    | 2021年              | 2020年              |
|----------------|-------|--------------------|--------------------|
| <b>資産</b>      |       |                    |                    |
| マスターファンドへの投資   |       | 383,939,220        | 399,524,080        |
| マスターファンドからの未収金 |       | 2,999,972          | 992,628            |
| 現金             |       | 5,509,620          | 4,572,822          |
| その他の資産         |       | 639,557            | 470,784            |
|                |       | <u>393,088,369</u> | <u>405,560,314</u> |
| <b>負債</b>      |       |                    |                    |
| 未払金及び未払費用      | 3,4,6 | 901,543            | 1,006,139          |
|                |       | <u>901,543</u>     | <u>1,006,139</u>   |
| <b>純資産</b>     |       |                    |                    |
|                |       | <u>392,186,826</u> | <u>404,554,175</u> |

添付の財務諸表注記参照。

## スーパーファンド・ジャパンスーパーファンド・グリーンCジャパン

## 損益計算書（未監査）

2021年1月1日から2021年6月30日の期間（及び2020年1月1日から2020年6月30日の期間）

（単位：日本円）

|                                                         | 注記 | 2021年6月30日に<br>終了した期間 | 2020年6月30日に<br>終了した期間 |
|---------------------------------------------------------|----|-----------------------|-----------------------|
| <b>マスターファンドから配分された正味投資損失</b>                            |    |                       |                       |
| 受取利息                                                    |    | 17,690                | 1,677,569             |
| 費用                                                      |    | (16,397,634)          | (18,731,704)          |
|                                                         |    | (16,379,944)          | (17,054,135)          |
| <b>費用</b>                                               |    |                       |                       |
| 事務管理報酬                                                  | 6  | 535,120               | 532,140               |
| 受託会社報酬                                                  | 5  | 588,811               | 456,987               |
| 代行協会員報酬                                                 | 4  | 196,571               | 212,142               |
| 管理報酬                                                    | 3  | 196,539               | 212,115               |
| 専門家報酬                                                   |    | 285,872               | —                     |
| 一般管理費                                                   |    | 777,685               | 1,227,971             |
|                                                         |    | 2,580,598             | 2,641,355             |
| <b>正味投資損失</b>                                           |    | (18,960,542)          | (19,695,490)          |
| <b>サブファンドの外貨に係る実現及び<br/>未実現損失の変動</b>                    |    |                       |                       |
| 外貨に係る正味実現利益／（損失）                                        |    | 376,998               | (180,221)             |
| 外貨に係る未実現（損失）／利益の変動                                      |    | (190,563)             | 99,255                |
|                                                         |    | 186,435               | (80,966)              |
| <b>マスターファンドから配分された投資及び<br/>外貨に係る正味実現及び未実現利益<br/>の変動</b> |    |                       |                       |
| 投資及び外貨に係る正味実現利益                                         |    | 78,811,746            | 56,414,915            |
| 投資及び外貨に係る未実現損失の変動                                       |    | (6,980,041)           | (11,728,846)          |
|                                                         |    | 71,831,705            | 44,686,069            |
| <b>営業活動から生じた純資産の正味増加額</b>                               |    | 53,057,598            | 24,909,613            |

添付の財務諸表注記参照。

## スーパーファンド・ジャパンスーパーファンド・グリーンCジャパン

## 純資産変動計算書（未監査）

2021年1月1日から2021年6月30日の期間（及び2020年1月1日から2020年6月30日の期間）

（単位：日本円）

|                      | 2021年                     | 2020年                     |
|----------------------|---------------------------|---------------------------|
| <b>営業活動</b>          |                           |                           |
| 正味投資損失               | (18,960,542)              | (19,695,490)              |
| 投資及び外貨に係る正味実現利益      | 79,188,744                | 56,234,694                |
| 投資及び外貨に係る未実現損失の変動    | (7,170,604)               | (11,629,591)              |
|                      | <u>53,057,598</u>         | <u>24,909,613</u>         |
| <b>資本取引</b>          |                           |                           |
| 円・クラス受益証券の買戻しに係る支払   | (28,439,757)              | (8,074,368)               |
| 米ドル・クラス受益証券の買戻しに係る支払 | (9,964,008)               | (16,695,152)              |
|                      | <u>(38,403,765)</u>       | <u>(24,769,520)</u>       |
| <b>当期純資産増加額</b>      | <u>14,653,833</u>         | <u>140,093</u>            |
| <b>期首純資産残高</b>       | 377,532,993               | 404,414,082               |
| <b>期末純資産残高</b>       | <u><u>392,186,826</u></u> | <u><u>404,554,175</u></u> |

添付の財務諸表注記参照。

## スーパーファンド・ジャパンスーパーファンド・シャープパリティ

## 貸借対照表（未監査）

2021年及び2020年6月30日現在

（単位：日本円）

|                       | 注記    | 2021年              | 2020年              |
|-----------------------|-------|--------------------|--------------------|
| <b>資産</b>             |       |                    |                    |
| マスターファンドへの投資          |       | 252,040,519        | 230,183,860        |
| マスターファンドからの未収金        |       | 3,647,906          | 421,042            |
| 現金                    |       | 25,536             | 100,000            |
| 外貨建て現金（原価：6,210,949円） |       | 6,502,645          | 4,516,500          |
| その他の資産                |       | 632,266            | 467,184            |
|                       |       | <u>262,848,872</u> | <u>235,688,586</u> |
| <b>負債</b>             |       |                    |                    |
| 未払金及び未払費用             | 3,4,6 | 826,835            | 860,006            |
|                       |       | <u>826,835</u>     | <u>860,006</u>     |
| <b>純資産</b>            |       |                    |                    |
|                       |       | <u>262,022,037</u> | <u>234,828,580</u> |

添付の財務諸表注記参照。

## スーパーファンド・ジャパンスーパーファンド・シャープパリティ

## 損益計算書（未監査）

2021年1月1日から2021年6月30日の期間（及び2020年1月1日から2020年6月30日の期間）

（単位：日本円）

|                                                              | 注記 | 2021年6月30日に<br>終了した期間 | 2020年6月30日に<br>終了した期間 |
|--------------------------------------------------------------|----|-----------------------|-----------------------|
| <b>マスターファンドから配分された正味投資損失</b>                                 |    |                       |                       |
| 受取利息                                                         |    | —                     | —                     |
| 費用                                                           |    | (2,151,715)           | (2,998,160)           |
|                                                              |    | (2,151,715)           | (2,998,160)           |
| <b>費用</b>                                                    |    |                       |                       |
| 専門家報酬                                                        |    | 193,849               | 750,484               |
| 販売報酬                                                         |    | 752,119               | 687,365               |
| 事務管理報酬                                                       | 6  | 540,082               | 537,078               |
| 受託会社報酬                                                       | 5  | 588,811               | 456,987               |
| 代行協会員報酬                                                      | 4  | 125,355               | 114,562               |
| 管理報酬                                                         | 3  | 125,327               | 114,528               |
| 一般管理費                                                        |    | 906,137               | 1,102,735             |
|                                                              |    | 3,231,680             | 3,763,739             |
| <b>正味投資損失</b>                                                |    | (5,383,395)           | (6,761,899)           |
| <b>サブファンドの外貨に係る実現及び<br/>未実現利益／（損失）の変動</b>                    |    |                       |                       |
| 外貨に係る正味実現損失                                                  |    | (60,994)              | (108,816)             |
| 外貨に係る未実現利益／（損失）の変動                                           |    | 330,543               | (63,737)              |
|                                                              |    | 269,549               | (172,553)             |
| <b>マスターファンドから配分された投資及び<br/>外貨に係る正味実現及び未実現利益／（損<br/>失）の変動</b> |    |                       |                       |
| 投資及び外貨に係る正味実現利益／（損失）                                         |    | 26,920,057            | (12,689,380)          |
| 投資及び外貨に係る未実現（損失）／<br>利益の変動                                   |    | (8,282,036)           | 12,971,822            |
|                                                              |    | 18,638,021            | 282,442               |
| <b>営業活動から生じた純資産の<br/>正味増加／（減少）額</b>                          |    | 13,524,175            | (6,652,010)           |

添付の財務諸表注記参照。



## スーパーファンド・ジャパンスーパーファンド・シャープパリティ

## 純資産変動計算書（未監査）

2021年1月1日から2021年6月30日の期間（及び2020年1月1日から2020年6月30日の期間）

（単位：日本円）

|                        | 2021年                     | 2020年                     |
|------------------------|---------------------------|---------------------------|
| <b>営業活動</b>            |                           |                           |
| 正味投資損失                 | (5,383,395)               | (6,761,899)               |
| 投資及び外貨に係る正味実現利益／損失     | 26,859,063                | (12,798,196)              |
| 投資及び外貨に係る未実現（損失）／利益の変動 | (7,951,493)               | 12,908,085                |
|                        | <u>13,524,175</u>         | <u>(6,652,010)</u>        |
| <b>資本取引</b>            |                           |                           |
| ゴールド円・クラス受益証券の発行に係る収入  | —                         | 100,000                   |
| ゴールド円・クラス受益証券の買戻しに係る支払 | (572,741)                 | (2,960,800)               |
| 円・クラス受益証券の買戻しに係る支払     | (6,927,340)               | (8,255,061)               |
|                        | <u>(7,500,081)</u>        | <u>(11,115,861)</u>       |
| <b>当期純資産増価／減少額</b>     | <u>6,024,094</u>          | <u>(17,767,871)</u>       |
| <b>期首純資産残高</b>         | 255,997,943               | 252,596,451               |
| <b>期末純資産残高</b>         | <u><u>262,022,037</u></u> | <u><u>234,828,580</u></u> |

添付の財務諸表注記参照。

## スーパーファンド・ジャパンスーパーファンド・レッド・ジャパン

## 貸借対照表（未監査）

2021年及び2020年6月30日現在

（単位：米ドル）

|                      |       | 2021年     |         | 2020年     |         |
|----------------------|-------|-----------|---------|-----------|---------|
|                      | 注記    | 米ドル       | 千円      | 米ドル       | 千円      |
| 資産                   |       |           |         |           |         |
| マスターファンドへの投資         |       | 8,201,782 | 901,376 | 6,855,994 | 753,474 |
| マスターファンドからの未収金       |       | 9,482     | 1,042   | 17,935    | 1,971   |
| 現金                   |       | 35,227    | 3,871   | 32,198    | 3,539   |
| 外貨建て現金（原価：69,297米ドル） |       | 65,192    | 7,165   | 1,964     | 216     |
| その他の資産               |       | 6,014     | 661     | 4,451     | 489     |
|                      |       | 8,317,697 | 914,115 | 6,912,542 | 759,688 |
| 負債                   |       |           |         |           |         |
| 前受申込金                |       | 50,400    | 5,539   | 927       | 102     |
| 未払金及び未払費用            | 3,4,6 | 18,366    | 2,018   | 20,021    | 2,200   |
|                      |       | 68,766    | 7,557   | 20,948    | 2,302   |
| 純資産                  |       |           |         |           |         |
|                      |       | 8,248,931 | 906,558 | 6,891,594 | 757,386 |

添付の財務諸表注記参照。

## スーパーファンド・ジャパンスーパーファンド・レッド・ジャパン

## 損益計算書（未監査）

2021年1月1日から2021年6月30日の期間（及び2020年1月1日から2020年6月30日の期間）

（単位：米ドル）

|                                             |    | 2021年6月30日に<br>終了した6ヶ月 |          | 2020年6月30日に<br>終了した6ヶ月 |          |
|---------------------------------------------|----|------------------------|----------|------------------------|----------|
|                                             | 注記 | 米ドル                    | 千円       | 米ドル                    | 千円       |
| マスターファンドから配分された                             |    |                        |          |                        |          |
| 正味投資損失                                      |    |                        |          |                        |          |
| 受取利息                                        |    | 554                    | 61       | 25,283                 | 2,779    |
| 費用                                          |    | (181,504)              | (19,947) | (155,574)              | (17,098) |
|                                             |    | (180,950)              | (19,886) | (130,291)              | (14,319) |
| 費用                                          |    |                        |          |                        |          |
| 事務管理報酬                                      | 6  | 5,003                  | 550      | 4,968                  | 546      |
| 受託会社報酬                                      | 5  | 5,455                  | 600      | 4,227                  | 465      |
| 専門家報酬                                       |    | 6,057                  | 666      | —                      | —        |
| 代行協会員報酬                                     | 4  | 4,159                  | 457      | 3,441                  | 378      |
| 管理報酬                                        | 3  | 4,159                  | 457      | 3,441                  | 378      |
| 一般管理費                                       |    | 18,737                 | 2,059    | 25,051                 | 2,753    |
|                                             |    | 43,570                 | 4,788    | 41,128                 | 4,520    |
|                                             |    | (224,520)              | (24,675) | (171,419)              | (18,839) |
| 正味投資損失                                      |    |                        |          |                        |          |
| サブファンドの外貨に係る実現及び未実現損失の変動                    |    |                        |          |                        |          |
| 外貨に係る正味実現損失                                 |    | (638)                  | (70)     | (613)                  | (67)     |
| 外貨に係る未実現損失の変動                               |    | (2,400)                | (264)    | (871)                  | (96)     |
|                                             |    | (3,038)                | (334)    | (1,484)                | (163)    |
| マスターファンドから配分された投資及び外貨に係る正味実現及び未実現利益／（損失）の変動 |    |                        |          |                        |          |
| 投資及び外貨に係る正味実現利益／（損失）                        |    | 845,884                | 92,963   | (259,211)              | (28,487) |
| 投資及び外貨に係る未実現損失の変動                           |    | (807,113)              | (88,702) | (138,788)              | (15,253) |
|                                             |    | 38,771                 | 4,261    | (397,999)              | (43,740) |
|                                             |    | (188,787)              | (20,748) | (570,902)              | (62,742) |
| 営業活動から生じた純資産の正味減少額                          |    |                        |          |                        |          |

添付の財務諸表注記参照。

## スーパーファンド・ジャパンスーパーファンド・レッド・ジャパン

## 純資産変動計算書（未監査）

2021年1月1日から2021年6月30日の期間（及び2020年1月1日から2020年6月30日の期間）

（単位：米ドル）

|                         | 2021年     |          | 2020年     |          |
|-------------------------|-----------|----------|-----------|----------|
|                         | 米ドル       | 千円       | 米ドル       | 千円       |
| <b>営業活動</b>             |           |          |           |          |
| 正味投資損失                  | (224,520) | (24,675) | (171,419) | (18,839) |
| 投資及び外貨に係る正味実現利益／（損失）    | 845,246   | 92,893   | (259,824) | (28,555) |
| 投資及び外貨に係る未実現損失の変動       | (809,513) | (88,965) | (139,659) | (15,349) |
|                         | (188,787) | (20,748) | (570,902) | (62,742) |
| <b>資本取引</b>             |           |          |           |          |
| ゴールド円・クラス受益証券の発行に係る収入   | 30,655    | 3,369    | 1,860     | 204      |
| シルバー米ドル・クラス受益証券の発行に係る収入 | 100,012   | 10,991   | —         | —        |
| シルバー円・クラス受益証券の発行に係る収入   | 77,126    | 8,476    | —         | —        |
| シルバー円・クラス受益証券の買戻しに係る支払  | (20,244)  | (2,225)  | —         | —        |
| ゴールド円・クラス受益証券の買戻しに係る支払  | (12,988)  | (1,427)  | (8,523)   | (937)    |
| 円・クラス受益証券の買戻しに係る支払      | (43,966)  | (4,832)  | (202,951) | (22,304) |
|                         | 130,595   | 14,352   | (209,614) | (23,037) |
| <b>当期純資産減少額</b>         | (58,192)  | (6,395)  | (780,516) | (85,779) |
| <b>期首純資産残高</b>          | 8,307,123 | 912,953  | 7,672,110 | 843,165  |
| <b>期末純資産残高</b>          | 8,248,931 | 906,558  | 6,891,594 | 757,386  |

添付の財務諸表注記参照。

**財務諸表注記（未監査）**

2021年及び2020年6月30日現在（単位：日本円）

**1. 設立及び主な活動**

スーパーファンド・ジャパン（以下、「当信託」という。）は、UBSファンド・サービシズ（ケイマン）リミテッド（以下、「退任受託会社」という。）及びスーパーファンド・ジャパン・トレーディング（ケイマン）リミテッド（以下、「管理会社」という。）の間で締結された信託証書（以下、「信託証書」という。）に従ってケイマン諸島の法律に基づいて設立された。当信託は2018年1月1日付けで、名称をスーパーファンド・グリーン・ゴールド・ジャパンから、スーパーファンド・ジャパンに変更した。当信託は、信託証書に従ってケイマン諸島の信託法に基づいて2009年6月5日に組織され、2009年6月29日にケイマン諸島のミューチュアル・ファンド法セクション4（1）（b）に基づいて登録された。退任・任命・変更証書に基づき、2015年5月8日付でハーニーズ・フィデューシャリー（ケイマン）リミテッド（以下、「受託会社」という。）が当信託の受託会社に任命された。受託会社の当信託に関する主な営業拠点はケイマン諸島である。

当信託はオープン・エンド型のアンブレラ・ファンドであり、スーパーファンド・グリーンAジャパン（2020年12月30日に償還された）、スーパーファンド・グリーン（旧称グリーンBジャパン）、スーパーファンド・グリーンCジャパン、スーパーファンド・シャープパリティ及びスーパーファンド・レッド・ジャパン（以下、それぞれ「サブファンド」、及び総称して「サブファンズ」という。）が設定されている。各サブファンドは独立した資産及び負債のプールとして、他のサブファンドと分別して管理されている。

2021年1月1日付で、スーパーファンド・グリーンBジャパンの名称は、スーパーファンド・ジャパン・サブファンド・グリーンに変更された。スーパーファンド・ジャパン株式会社（以下、「販売

会社」）は、2020年12月31日にサブファンド・スーパーファンド・グリーンAジャパンから強制的に償還された。2021年1月1日にスーパーファンド・グリーンAジャパンの受益者はスーパーファン

ド・グリーンBジャパンの対応するクラスの口数を獲得した。償還後、スーパーファンド・グリーンAジャパンは終了される。

スーパーファンド・グリーン（旧称グリーンBジャパン）は、その資産のほぼすべてをケイマン諸島の適用免除会社であるスーパーファンド・グリーンSPC及びスーパーファンド・グリーン・ゴールドSPCの分別ポートフォリオBに投資している。

スーパーファンド・グリーンCジャパンは、「マスター・フィーダー」構造の一部であり、その資産のほぼすべてをケイマン諸島の適用免除会社であるスーパーファンド・グリーンSPC（以下、「グリーン・マスターファンド」という。）の分別ポートフォリオCに投資している。

スーパーファンド・グリーン・ゴールドSPCは、「マスター・フィーダー」構造の一部であり、その資産のほぼすべてをケイマン諸島の適用免除会社であるスーパーファンド・グリーン・ゴールド・マスターSPC（以下、「グリーン・ゴールド・マスターファンド」という。）のスーパーファンド・グリーン・ゴールド・マスター・分別ポートフォリオに投資している。グリーン・ゴールド・マスターファンドの目的は、テクニカル分析の利用を通じて長期のキャピタル・ゲインを達成することである。グリーン・ゴールド・マスターファンドは、金先物を含む様々な種類の先物契約にその資産を投資しており、金現物にも投資する場合がある。

グリーン・マスターファンド、すなわちスーパーファンド・グリーンSPCは、「マスター・フィーダー」構造の一部であり、その資産のほぼすべてをケイマン諸島の適用免除会社であるスーパーファンド・グリーン・マスター（以下、「グリーン・アンダーライニング・マスターファンド」という。）に投資している。グリーン・アンダーライニング・マスターファンドの目的は、株式及び証券市場の動きの影響を受けない投資形態として、平均以上の長期的なキャピタル・ゲインを達成するための投資を投資家に提供するこ

とである。グリーン・アンダーライング・マスターファンドは、投資機会及び取引戦略を利用する意向であるため、対象とする先物投資の特性に関する見解を事前に決めているわけではなく、どのような制約も受けることはない。

スーパーファンド・シャープパリティは、「マスター・フィーダー」構造の一部であり、その資産のほぼすべてをケイマン諸島の適用免除会社であるスーパーファンドSPC分別ポートフォリオ・シャープパリティに投資している。マスターファンドの主たる目的は、先物及び先渡契約のレバレッジ取引を通じ、資本の増加を達成することである。当分別ポートフォリオ・シャープパリティは、投資目的を追及するにあたり、スーパーファンドグループの関連会社によって開発された独自の取引戦略を利用するロングオナーのリスクパリティ戦略を主に採用する。さらに他の戦略も限られた重みづけで合わせて使用される可能性がある。また、これらの戦略は、先物及び／又は先渡契約を空売りする可能性がある。

スーパーファンド・レッド・ジャパンは、「マスター・フィーダー」構造の一部であり、その資産のほぼすべてをケイマン諸島の適用免除会社であるスーパーファンド・レッド・ワンSPC（以下、「レッド・マスターファンド」という。）の分別ポートフォリオIに投資している。

レッド・マスターファンドの目的は、株式及び証券市場の動きの影響を受けない（実質的には、株式、証券及びオプション市場との相関関係に基づくものではない）投資形態として、平均以上の長期的なキャピタル・ゲインを達成するための投資を投資家に提供することである。分別ポートフォリオIの投資目的は、特定のソフトウェアを使用したテクニカル分析を行うことにより、長期のキャピタル・ゲインを達成することである。

グリーン・マスターファンド、シャープパリティ・マスターファンド及びレッド・マスターファンドを総称して「マスターファンド」という。グリーン・アンダーライング・マスターファンドは「アンダーライング・マスターファンド」という。

管理会社は、代行協会員契約に従って、スーパーファンド・ジャパン株式会社（以下、「販売会社」という。）を当信託の日本における代行協会員に選任している。代行協会員は1口当たり純資産価額を公表し、日本証券業協会（以下、「JSDA」という。）に財務諸表を提出する責任を有している。当信託の年次監査済財務諸表は、日本における開示義務の一環として有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれており、関東財務局に提出されている。

## 2. 重要な会計方針

当該財務諸表は、米国で一般に公正妥当と認められる会計原則に従って作成されている。当信託が適用した重要な会計方針は以下のとおりである。

### (a) 見積りの使用

GAAPに準拠した財務諸表の作成にあたって、経営陣は、財務諸表日現在の資産及び負債の報告金額並びに偶発資産及び負債の開示、並びに当報告期間中の収益及び費用の報告額に影響を及ぼす見積り及び仮定を行うことが求められている。実際の結果は、それらの見積りとは異なる可能性がある。

### (b) 受取利息及び支払利息

受取利息及び支払利息は、発生主義で計上される。

### (c) 外貨

外貨建て又は外貨で会計処理される資産及び負債は、貸借対照表日の為替レートで日本円に換算される。外貨建て取引は取引日の為替レートで日本円に換算される。換算によって生じる実現及び未実現利益及び損失は、損益計算書に含まれる。

### (d) 法人税等

ケイマン諸島では、収益又は利益に対して課税されることはなく、当信託は、租税特別措置法の条文に従い、2059年6月5日までの期間について将来の収益又は利益に対する現地の税金をすべて免除する旨の誓約をケイマン諸島の総督から受け取っている。よって、法人税等に関する引当金は当該財務諸表に含まれていない。

### 3. 管理報酬

当信託の投資活動は、共通支配下に置かれている関連当事者である管理会社により管理されている。投資顧問契約に基づいて、管理会社は、各サブファンドの純資産価額の0.1%（年率）相当の月次管理報酬を後払いで受領している。

2021年6月30日現在、未払金及び未払費用に含まれている未払管理報酬は、サブファンド・グリーン（旧称グリーンBジャパン）が559,559円、スーパーファンド・グリーンCジャパンが98,972円、スーパーファンド・シャープパリティが64,007円、スーパーファンド・レッド・ジャパンが2,118米ドルである。

### 4. 代行協会員報酬

販売会社は、各サブファンドの純資産価額の0.1%（年率）相当の報酬を受領する権限を有している。

2021年6月30日現在、未払金及び未払費用に含まれている各サブファンドの未払代行協会員報酬はサブファンド・グリーン（旧称グリーンBジャパン）が197,032円、スーパーファンド・グリーンCジャパンが36,387円、スーパーファンド・シャープパリティが23,850円、スーパーファンド・レッド・ジャパンが770米ドルである。

### 5. 受託会社報酬

受託会社は、各サブファンドにつき年間で8,500米ドルの報酬を受領する権限を有している。

2021年6月30日現在、サブファンド・グリーン（旧称グリーンBジャパン）、スーパーファンド・グリーンCジャパン、スーパーファンド・シャープパリティ、スーパーファンド・レッド・ジャパンに対する未払受託会社報酬はない。

### 6. 事務管理報酬

事務管理契約に基づいて、当信託はエイベックス・ファンド・サービシーズ・エス・エー（以下、「当管理会社」という。）に対し、毎月最終評価日において計算された報酬を後払いで支払っており、その金額はサブファンド・グリーン（旧称グリーンBジャパン）が年間12,364米ドル、スーパーファンド・グリーンCジャパンが年間9,898米ドル、スーパーファンド・シャープパリティ及びスーパーファンド・レッド・ジャパンが年間10,090米ドルである。

2021年6月30日現在の未払金及び未払費用に含まれている未払事務管理報酬は、サブファンド・グリーン（旧称グリーンBジャパン）が108,830円、スーパーファンド・グリーンCジャパンが87,996円、スーパーファンド・シャープパリティが88,811円、スーパーファンド・レッド・ジャパンが799米ドルである。

### 7. 純資産価額

各サブファンドの各クラス及びシリーズのユニット別純資産価額の概要は以下のとおりである。

#### サブファンド・グリーン（旧称：グリーンB・ジャパン）

2021年

#### **ユニット毎の純資産価額**

|                   |           |      |     |        |
|-------------------|-----------|------|-----|--------|
| 円建てーゴールド円・クラス     | 8,872,829 | ユニット | 日本円 | 133.19 |
| 円建てー円・クラス         | 8,430,227 | ユニット | 日本円 | 80.46  |
| 米ドル建てーゴールド米ドル・クラス | 199,419   | ユニット | 米ドル | 1.26   |
| 米ドル建てー米ドル・クラス     | 1,807,788 | ユニット | 米ドル | 1.00   |

2020年

#### **ユニット毎の純資産価額**

|                   |           |      |     |        |
|-------------------|-----------|------|-----|--------|
| 円建て－ゴールド円・クラス     | 7,022,654 | ユニット | 日本円 | 123.74 |
| 円建て－円・クラス         | 8,697,388 | ユニット | 日本円 | 74.58  |
| 米ドル建て－ゴールド米ドル・クラス | 114,927   | ユニット | 米ドル | 1.19   |
| 米ドル建て－米ドル・クラス     | 1,929,751 | ユニット | 米ドル | 0.96   |

#### スーパーファンド・グリーンCジャパン

2021年

##### ユニット毎の純資産価額

|               |           |      |     |       |
|---------------|-----------|------|-----|-------|
| 円建て－円・クラス     | 2,870,050 | ユニット | 日本円 | 83.46 |
| 米ドル建て－米ドル・クラス | 1,550,687 | ユニット | 米ドル | 0.89  |

2020年

##### ユニット毎の純資産価額

|               |           |      |     |       |
|---------------|-----------|------|-----|-------|
| 円建て－円・クラス     | 3,323,389 | ユニット | 日本円 | 75.42 |
| 米ドル建て－米ドル・クラス | 1,706,107 | ユニット | 米ドル | 0.83  |

#### スーパーファンド・シャープパリティ

2021年

##### ユニット毎の純資産価額

|               |           |      |     |       |
|---------------|-----------|------|-----|-------|
| 円建て－ゴールド円・クラス | 2,893,399 | ユニット | 日本円 | 68.71 |
| 円建て－円・クラス     | 1,390,688 | ユニット | 日本円 | 45.45 |

2020年

##### ユニット毎の純資産価額

|               |           |      |     |       |
|---------------|-----------|------|-----|-------|
| 円建て－ゴールド円・クラス | 2,921,977 | ユニット | 日本円 | 58.58 |
| 円建て－円・クラス     | 1,657,640 | ユニット | 日本円 | 38.41 |

#### レッド・ジャパン

2021年

##### ユニット毎の純資産価額

|                   |           |      |     |       |
|-------------------|-----------|------|-----|-------|
| 円建て－ゴールド円・クラス     | 1,900,708 | ユニット | 日本円 | 98.77 |
| 円建て－シルバー円・クラス     | 1,812,607 | ユニット | 日本円 | 80.74 |
| 円建て－円・クラス         | 1,443,336 | ユニット | 日本円 | 96.59 |
| 米ドル建て－ゴールド米ドル・クラス | 556,650   | ユニット | 米ドル | 0.87  |
| 米ドル建て－シルバー米ドル・クラス | 4,683,621 | ユニット | 米ドル | 0.71  |
| 米ドル建て－米ドル・クラス     | 222,195   | ユニット | 米ドル | 0.85  |

2020年

##### ユニット毎の純資産価額

|                   |           |      |     |       |
|-------------------|-----------|------|-----|-------|
| 円建て－ゴールド円・クラス     | 1,996,441 | ユニット | 日本円 | 96.22 |
| 円建て－シルバー円・クラス     | 1,733,829 | ユニット | 日本円 | 55.16 |
| 円建て－円・クラス         | 1,545,328 | ユニット | 日本円 | 90.99 |
| 米ドル建て－ゴールド米ドル・クラス | 556,650   | ユニット | 米ドル | 0.87  |
| 米ドル建て－シルバー米ドル・クラス | 4,530,528 | ユニット | 米ドル | 0.50  |
| 米ドル建て－米ドル・クラス     | 222,195   | ユニット | 米ドル | 0.82  |

## 8. 後発事象



これらの財務諸表を作成するにあたり、経営陣は、当該財務諸表の公表が可能となった2021年9月7日までのすべての重要な後発事象を評価し開示した。

2021年7月1日に、サブファンド・シャープパリティの名前はスーパーファンド・ジャパン・サブファンド・システムティック・オールウェザーに変更された。

[次へ](#)

## （３）投資有価証券明細表等

&lt;訂正前&gt;

## ② 株式以外の投資有価証券明細表

(2020年12月31日現在)

| サブファンド            |                                                  | 国          | 公正価額                                                     |
|-------------------|--------------------------------------------------|------------|----------------------------------------------------------|
| グリーン B (注2)       | スーパーファンド・グリーンSPC Bの株式<br>(クラスB・ジャパン)             | ケイマン<br>諸島 | <u>770,675,803円</u>                                      |
|                   | スーパーファンド・グリーン・ゴールドSPC Bの<br>株式 (クラスB・ジャパン)       | ケイマン<br>諸島 | <u>1,086,443,478円</u>                                    |
| グリーンC             | スーパーファンド・グリーンSPC Cの株式<br>(クラス・ジャパン)              | ケイマン<br>諸島 | <u>372,262,980円</u>                                      |
| レッド               | スーパーファンド・レッドワンSPCの株式<br>(クラス・ジャパン・米ドル)           | ケイマン<br>諸島 | <u>1,472,448.40</u><br>米ドル<br>( <u>161,615,936</u><br>円) |
|                   | スーパーファンド・レッドワンSPCの株式<br>(クラス・ジャパン・ゴールド)          | ケイマン<br>諸島 | <u>2,352,980.82</u><br>米ドル<br>( <u>258,263,175</u><br>円) |
|                   | スーパーファンド・レッドワンSPCの株式<br>(クラス・ジャパン・シルバー)          | ケイマン<br>諸島 | <u>4,497,513.29</u><br>米ドル<br>( <u>493,647,059</u><br>円) |
| シャープ<br>パリティ (注3) | スーパーファンドSPCの株式 (分別ポートフォリ<br>オ・シャープパリティ・クラスBジャパン) | ケイマン<br>諸島 | <u>65,016,960円</u>                                       |
|                   | スーパーファンドSPCの株式 (分別ポートフォリ<br>オ・シャープパリティ・クラスBジャパン) | ケイマン<br>諸島 | <u>1,463,359.16</u><br>ユーロ<br>( <u>195,709,654</u><br>円) |

(中略)

(注3) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システムティック・オールウェザー」と名称が変更される予定である。

&lt;訂正後&gt;

## ② 株式以外の投資有価証券明細表

(2021年7月31日現在)

| サブファンド                                   |                                                     | 国          | 公正価額                                      |
|------------------------------------------|-----------------------------------------------------|------------|-------------------------------------------|
| グリーン <sup>(注1)</sup><br>(注2)             | スーパーファンド・グリーンSPC Bの株式<br>(クラスB・ジャパン)                | ケイマン<br>諸島 | 1,228,105,140円                            |
|                                          | スーパーファンド・グリーン・ゴールドSPC Bの<br>株式 (クラスB・ジャパン)          | ケイマン<br>諸島 | 892,866,824円                              |
| グリーンC                                    | スーパーファンド・グリーンSPC Cの株式<br>(クラス・ジャパン)                 | ケイマン<br>諸島 | 397,506,099円                              |
| レッド                                      | スーパーファンド・レッドワンSPCの株式<br>(クラス・ジャパン・米ドル)              | ケイマン<br>諸島 | 1,438,022.40<br>米ドル<br>(158,038,662<br>円) |
|                                          | スーパーファンド・レッドワンSPCの株式<br>(クラス・ジャパン・ゴールド)             | ケイマン<br>諸島 | 2,264,848.04<br>米ドル<br>(248,906,800<br>円) |
|                                          | スーパーファンド・レッドワンSPCの株式<br>(クラス・ジャパン・シルバー)             | ケイマン<br>諸島 | 4,663,769.40<br>米ドル<br>(512,548,257<br>円) |
| システマティッ<br>ク・オールウェ<br>ザー <sup>(注3)</sup> | スーパーファンドSPCの株式<br>(分別ポートフォリオ・シャープパリティ・<br>クラスBジャパン) | ケイマン<br>諸島 | 4,519,073円                                |
|                                          | スーパーファンドSPCの株式<br>(分別ポートフォリオ・シャープパリティ・<br>クラスBジャパン) | ケイマン<br>諸島 | 1,587,910.67<br>ユーロ<br>(205,936,135<br>円) |

(中略)

(注3) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システマティック・オールウェザー」と名称が変更された。

## ２ ファンドの現況

### 純資産額計算書

<訂正前>

(2021年 3月31日現在)

|              |                           |                                       |
|--------------|---------------------------|---------------------------------------|
| グリーン（注２）（注３） | I 資産総額（円）                 | <u>2,266,886,221</u>                  |
|              | II 負債総額（円）                | <u>36,040,151</u>                     |
|              | III 純資産総額（I－II）（円）        | <u>2,230,846,070</u>                  |
|              | IV 発行済数量                  | <u>21,280,043.58</u>                  |
|              | V 1単位当たり純資産額（III／IV）（円）   | <u>104.83</u>                         |
| グリーンC        | I 資産総額（円）                 | <u>383,096,818</u>                    |
|              | II 負債総額（円）                | <u>653,381</u>                        |
|              | III 純資産総額（I－II）（円）        | <u>382,443,437</u>                    |
|              | IV 発行済数量                  | <u>4,420,737</u>                      |
|              | V 1単位当たり純資産額（III／IV）（円）   | <u>86.51</u>                          |
| レッド          | I 資産総額（米ドル）               | <u>7,822,557.50</u><br>(858,603,911円) |
|              | II 負債総額（米ドル）              | <u>126,531.38</u><br>(13,888,084円)    |
|              | III 純資産総額（I－II）（米ドル）      | <u>7,696,026.12</u><br>(844,715,827円) |
|              | IV 発行済数量                  | <u>10,514,482.56</u>                  |
|              | V 1単位当たり純資産額（III／IV）（米ドル） | <u>0.73</u><br>(80.12円)               |
| シャープパリティ（注４） | I 資産総額（円）                 | <u>244,797,691</u>                    |
|              | II 負債総額（円）                | <u>613,808</u>                        |
|              | III 純資産総額（I－II）（円）        | <u>244,183,883</u>                    |
|              | IV 発行済数量                  | <u>4,408,171.83</u>                   |
|              | V 1単位当たり純資産額（III／IV）（円）   | <u>55.39</u>                          |

(中略)

(注４) サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システマティック・オールウェザー」と名称が変更される予定である。

&lt;訂正後&gt;

(2021年7月31日現在)

|                          |                           |                                       |
|--------------------------|---------------------------|---------------------------------------|
| グリーン（注2）（注3）             | I 資産総額（円）                 | <u>2,178,926,977</u>                  |
|                          | II 負債総額（円）                | <u>24,371,906</u>                     |
|                          | III 純資産総額（I－II）（円）        | <u>2,154,555,071</u>                  |
|                          | IV 発行済数量                  | <u>19,303,967.88</u>                  |
|                          | V 1単位当たり純資産額（III／IV）（円）   | <u>111.61</u>                         |
| グリーンC                    | I 資産総額（円）                 | <u>406,120,473</u>                    |
|                          | II 負債総額（円）                | <u>868,832</u>                        |
|                          | III 純資産総額（I－II）（円）        | <u>405,251,641</u>                    |
|                          | IV 発行済数量                  | <u>4,420,737.00</u>                   |
|                          | V 1単位当たり純資産額（III／IV）（円）   | <u>91.67</u>                          |
| レッド                      | I 資産総額（米ドル）               | <u>8,445,921.19</u><br>(928,206,739円) |
|                          | II 負債総額（米ドル）              | <u>20,624.08</u><br>(2,266,586円)      |
|                          | III 純資産総額（I－II）（米ドル）      | <u>8,425,297.11</u><br>(925,940,152円) |
|                          | IV 発行済数量                  | <u>10,643,978.47</u>                  |
|                          | V 1単位当たり純資産額（III／IV）（米ドル） | <u>0.79</u><br>(86.82円)               |
| システムティック・<br>オールウェザー（注4） | I 資産総額（円）                 | <u>291,254,992</u>                    |
|                          | II 負債総額（円）                | <u>10,749,551</u>                     |
|                          | III 純資産総額（I－II）（円）        | <u>280,505,441</u>                    |
|                          | IV 発行済数量                  | <u>4,442,246.46</u>                   |
|                          | V 1単位当たり純資産額（III／IV）（円）   | <u>63.14</u>                          |

(中略)

（注4）サブファンド「シャープパリティ」は、2021年7月1日付で、サブファンド「システムティック・オールウェザー」と名称が変更された。

[次へ](#)

## 第三部 特別情報

### 第1 管理会社の概況

#### 2 事業の内容及び営業の概況

<訂正前>

(前略)

| 名 称                      | 設 立 国  | 種 類<br>(基本的性格)         | 純資産額合計（通貨別）<br>(2021年 3月31日現在)     |
|--------------------------|--------|------------------------|------------------------------------|
| スーパーファンド・ジャパン<br>(当ファンド) | ケイマン諸島 | 適用免除、有限責任オープン・エンド型投資信託 | 2,938,018,683円                     |
|                          |        |                        | 6,975,388.81米ドル<br>(約765,618,676円) |

<訂正後>

(前略)

| 名 称                      | 設 立 国  | 種 類<br>(基本的性格)         | 純資産額合計（通貨別）<br>(2021年 7月31日現在)     |
|--------------------------|--------|------------------------|------------------------------------|
| スーパーファンド・ジャパン<br>(当ファンド) | ケイマン諸島 | 適用免除、有限責任オープン・エンド型投資信託 | 2,927,844,907円                     |
|                          |        |                        | 7,631,581.26米ドル<br>(約838,710,780円) |

[次へ](#)

### 3 管理会社の経理状況

#### (1) 貸借対照表

以下が「3 管理会社の経理状況、(1) 貸借対照表」の終わりに追加挿入される。

1. 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（以下、「管理会社」という。）の2021年6月30日に終了した6ヶ月に係る日本文の中間財務書類は、米国において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成された管理会社の原文の中間財務書類を、「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」（平成5年大蔵省令第22号）に基づき、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第76条第4項ただし書の規定を適用して翻訳したものである。
2. 管理会社の原文の中間財務書類は、独立監査人の監査を受けていない。
3. 管理会社の原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本文の中間財務書類には、原文の中間財務書類中の米ドル表示の金額のうち主要なものについて円換算額が併記されている。日本円への換算には、2021年8月31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＝109.90円）が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

## （１）資産及び負債の状況

## 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

## 貸借対照表（未監査）

2021年6月30日現在

（単位：米ドル）

|            |    | 2021年 6 月30日 |        | 2020年12月31日 |        |
|------------|----|--------------|--------|-------------|--------|
|            | 注記 | 米ドル          | 千円     | 米ドル         | 千円     |
| 資産         |    |              |        |             |        |
| 現金         |    | 438,423      | 48,183 | 475,559     | 52,264 |
| 未収管理報酬     | 4  | 8,622        | 948    | 8,495       | 934    |
| 立替費用       |    | 964          | 106    | —           | —      |
| 資産合計       |    | 448,009      | 49,236 | 484,054     | 53,198 |
| 負債         |    |              |        |             |        |
| 未払財務諸表作成費  |    | 4,831        | 531    | 3,090       | 340    |
| 未払専門家報酬    |    | 3,271        | 359    | 4,851       | 533    |
| その他未払専門家報酬 |    | —            | —      | 2,286       | 251    |
| 負債合計       |    | 8,102        | 890    | 10,227      | 1,124  |
| 株主持分       |    |              |        |             |        |
| 株式資本       | 3  | 1            | 0      | 1           | 0      |
| 資本剰余金      | 3  | 420,786      | 46,244 | 420,786     | 46,244 |
| 利益剰余金      |    | 19,120       | 2,101  | 53,040      | 5,829  |
|            |    | 439,907      | 48,346 | 473,827     | 52,074 |
| 負債合計及び株主持分 |    | 448,009      | 49,236 | 484,054     | 53,198 |

添付の財務諸表注記参照。



## 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

## 損益計算書（未監査）

2021年6月30日に終了した6ヶ月

（単位：米ドル）

|              |    | 2021年 6 月30日 |         | 2020年 6 月30日 |       |
|--------------|----|--------------|---------|--------------|-------|
|              | 注記 | 米ドル          | 千円      | 米ドル          | 千円    |
| <b>収益</b>    |    |              |         |              |       |
| 管理報酬         | 4  | 17,077       | 1,877   | 14,830       | 1,630 |
| 正味為替益        |    | —            | —       | 2,916        | 320   |
|              |    | 17,077       | 1,877   | 17,746       | 1,950 |
| <b>費用</b>    |    |              |         |              |       |
| 取締役報酬及び費用    | 5  | 33,466       | 3,678   | —            | 0     |
| 財務諸表作成費      |    | 7,500        | 824     | 7,500        | 824   |
| 専門家報酬        |    | 3,271        | 359     | 3,369        | 370   |
| その他専門家報酬及び費用 |    | 5,771        | 634     | 2,426        | 267   |
| 弁護士報酬及び費用    |    | —            | 0       | 823          | 90    |
| 銀行手数料        |    | 13           | 1       | 10           | 1     |
| その他の費用       |    | 976          | 107     | 1,138        | 125   |
|              |    | 50,997       | 5,605   | 15,266       | 1,678 |
| <b>当期純利益</b> |    | (33,920)     | (3,728) | 2,480        | 273   |

添付の財務諸表注記参照。

## 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

## 株主持分変動表（未監査）

2021年6月30日に終了した6ヶ月

（単位：米ドル）

|                | 株式数 | 株式資本<br>米ドル | 資本剰余金<br>米ドル | 利益剰余金<br>米ドル | 合計<br>米ドル |
|----------------|-----|-------------|--------------|--------------|-----------|
| 2021年1月1日現在残高  | 1   | 1           | 420,786      | 53,040       | 473,827   |
| 当期純利益          | —   | —           | —            | —33,920      | —33,920   |
| 2021年6月30日現在残高 | 1   | 1           | 420,786      | 19,120       | 439,907   |

|                | 株式数 | 株式資本<br>千円 | 資本剰余金<br>千円 | 利益剰余金<br>千円 | 合計<br>千円 |
|----------------|-----|------------|-------------|-------------|----------|
| 2021年1月1日現在残高  | 1   | 0          | 46,244      | 5,829       | 52,074   |
| 当期純利益          | —   | —          | —           | —3,728      | —3,728   |
| 2021年6月30日現在残高 | 1   | 0          | 46,244      | 2,101       | 48,346   |

|                | 株式数 | 株式資本<br>米ドル | 資本剰余金<br>米ドル | 利益剰余金<br>米ドル | 合計<br>米ドル |
|----------------|-----|-------------|--------------|--------------|-----------|
| 2020年1月1日現在残高  | 1   | 1           | 420,786      | 34,537       | 455,324   |
| 当期純利益          | —   | —           | —            | 2,480        | 2,480     |
| 2021年6月30日現在残高 | 1   | 1           | 420,786      | 37,017       | 457,804   |

|                | 株式数 | 株式資本<br>千円 | 資本剰余金<br>千円 | 利益剰余金<br>千円 | 合計<br>千円 |
|----------------|-----|------------|-------------|-------------|----------|
| 2020年1月1日現在残高  | 1   | 0          | 46,244      | 3,796       | 50,040   |
| 当期純利益          | —   | —          | —           | 273         | 273      |
| 2020年6月30日現在残高 | 1   | 0          | 46,244      | 4,068       | 50,313   |

添付の財務諸表注記参照。

**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**  
**キャッシュ・フロー表（未監査）**

2021年6月30日に終了した6ヶ月

（単位：米ドル）

|                         | 2021年6月30日 |         | 2020年6月30日 |        |
|-------------------------|------------|---------|------------|--------|
|                         | 米ドル        | 千円      | 米ドル        | 千円     |
| <b>営業活動によるキャッシュ・フロー</b> |            |         |            |        |
| 当期純益                    | (33,920)   | (3,728) | 2,480      | 273    |
| 現金営業活動における当期純利益の調整：     |            |         |            |        |
| 未収管理報酬の（増加）／減少          | (127)      | (14)    | (518)      | (57)   |
| 売掛金及び前払金の（増加）／減少        | (964)      | (106)   | (368)      | (40)   |
| 未払金及び未払費用の（減少）          | (2,125)    | (234)   | (8,496)    | (934)  |
| 営業活動によって使用された<br>正味現金収支 | (37,136)   | (4,081) | (6,902)    | (759)  |
| 当期中の現金の純減少              | (37,136)   | (4,081) | (6,902)    | (759)  |
| 期首現金残高                  | 475,559    | 52,264  | 465,818    | 51,193 |
| 期末現金残高                  | 438,423    | 48,183  | 458,916    | 50,435 |

添付の財務諸表注記参照。

## 財務諸表注記

2021年6月30日

（単位：米ドル）

### 1. 会社設立及び基礎情報

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（以下「当社」という。）は、2004年10月8日にケイマン諸島の会社法に基づいて適用免除有限会社として設立され、2006年1月1日に開業した。

当社の主な活動は、スーパーファンド・ジャパン（以下「当信託」という。）に対して投資運用サービスを提供することである。2018年には、当社は2018年7月1日に運用を停止したスーパーファンド・グリーン・ジャパンにも投資運用サービスを提供していた。スーパーファンド・ジャパンは、2017年12月31日に、スーパーファンド・ブルー・ジャパン、スーパーファンド・グリーン・ワン・ジャパン、スーパーファンド・レッド・ジャパンをスーパーファンド・グリーン・ゴールド・ジャパンへと統合した成果である。2018年1月1日付けで、スーパーファンド・グリーン・ゴールド・ジャパンはスーパーファンド・ジャパンへと名称を変更された。また、2020年1月2日付でスーパーファンド・ジャパン・サブファンド・ブルーはスーパーファンド・ジャパン・サブファンド・シャープパリティへ名称が変更された。2021年1月1日付、スーパーファンド・グリーンB・ジャパンはスーパーファンド・ジャパン・サブファンド・グリーンと名前を変更し、サブファンド・グリーンAは運用を終了した。

当社は本信託の投資運用会社を務め、代行協会員契約に従って、スーパーファンド・ジャパン株式会社を日本における当信託の代行協会員として選任している。代行協会員は、1口当たり純資産価額を公表し、日本証券業協会に財務諸表を提出する責任がある。スーパーファンド・ジャパン株式会社は、当信託の販売会社としての業務も行っている。当社及び当信託の年次監査済財務諸表は、日本における開示義務の一環として有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれており、関東財務局に提出されている。

### 2. 重要な会計方針

#### (a) 準拠基準

当該財務諸表は、米国で一般に公正妥当と認められる会計原則（以下、「US GAAP」という。）に従って作成されている。

#### (b) 外貨換算

当社の財務諸表は米ドル建てで表示している。外貨建て取引は、取引日現在の為替レートで換算される。期末日現在のすべての外貨建て資産及び負債は、同日の為替レートで米ドル（\$）に換算される。換算より生じる為替換算差額は損益計算書において認識される。

#### (c) 見積りの使用

US GAAPに準拠した財務諸表の作成にあたって、経営陣は財務諸表日現在の資産及び負債の報告額並びに偶発資産及び負債の開示、並びに当期中の収益及び費用の報告額に影響を及ぼす見積り及び仮定を行うことが求められている。実際の結果は、それらの見積額とは異なる可能性がある。公正価値は特定時点において市況及び金融商品の情報に基づき見積られる。これらの見積りは本来主観的なものであり、不確実性及び重要な判断を伴うため、正確に算出することはできない。仮定の変更は見積りに重要な影響を与える場合がある。

#### (d) 現金

現金は銀行預金で構成されており、全額が、満期まで3ヶ月以内で流動性が高いとみなされている。

#### (e) 未収管理報酬

未収管理報酬は投資管理会社としてのサービス提供先である信託に対して請求した管理報酬である。

当社の方針では一般貸倒引当金を設定していないが、すべての未収金は12ヶ月経過後に回収不能とみなされ償却される。

(f) 収益及び費用

収益及び費用は発生基準で計上される。

(g) 法人税等

ケイマン諸島では収益又は利益に対して課税されることはなく、仮に課税された場合でも2024年10月26日まで現地の収益、利益及び資本等に係る税金の適用を免除する旨の合意をケイマン諸島の総督から受け取っている。よって、法人税等に関する引当金は当該財務諸表に含まれていない。

(h) 運用資産

運用中の信託の各サブファンドの資産及び負債は当社の資産又は負債ではないため、当該財務諸表には表示されていない。

### 3. 株式資本

|                              | 2021年6月30日 | 2020年6月30日 |
|------------------------------|------------|------------|
|                              | 米ドル        | 米ドル        |
| 授權済：                         |            |            |
| 各1円の償還可能参加型議決権付株式50,000,000株 | 351,212    | 351,212    |
| 発行済及び全額払込済：                  |            |            |
| 1円の償還可能参加型議決権付株式1株           | 1          | 1          |
| 資本剰余金                        | 420,786    | 420,786    |

### 4. 管理報酬

当社は信託の各サブファンドの純資産の0.10%（年率）の管理報酬を、各サブファンドによって、半年ごと、四半期ごと又は月ごとに後払いで受領している。管理報酬は、独立第三者間条件での交渉に基づき設定されたものではない。

2021年6月30日に終了した6ヶ月において、当社は信託から17,077米ドル（2020年6月30日：14,830米ドル）の管理報酬を稼得しており、そのうち8,622米ドル（2020年6月30日：7,577米ドル）が同日現在未払となっている。

### 5. 関連当事者間取引

当社は信託の投資運用活動に関して一定の支配力及び重要な影響力を有することから、信託の関連当事者とみなされる。

2021年6月30日に終了した6ヶ月において、取締役は当社から7,500米ドル（2020年6月30日：7,500米ドル）の報酬及び費用を稼得しており、同日現在、未払となっている金額はない（2020年：なし）。

### 6. 金融商品の公正価値

金融資産及び負債は満期までの期間が比較的に短いため、その帳簿価額は公正価値に近似している。

### 7. 金融商品及び関連リスク

#### 信用リスク

信用リスクとは、取引相手とその義務の条件に従い当社に対して義務を履行できなかった場合に当社が被る可能性のある損失のことである。金融資産は、潜在的に当社を信用リスクにさらす可能性のある資産であり、主に現金及び現金同等物、並びに未収管理報酬で構成される。信用リスクの最大エクスポージャーは、かかる金融資産の帳簿価額に等しい。当社が現金残高を信用のある金融機関に預け、また未収

管理報酬はその性質上短期であることから、現金及び現金同等物、並びに未収管理報酬に係る信用リスクは低いとみなされる。

#### 通貨リスク

当社は、米ドルの他の通貨に対する換算レートが、米ドル以外の通貨建ての当社の資産及び負債の報告数値に不利な影響を及ぼす形で変動する可能性があるリスクにさらされている。

#### 8. 後発事象

これらの財務諸表を作成するにあたり、経営陣は、当該財務諸表の公表が可能となった2021年9月7日までのすべての重要な後発事象を評価し、開示した。

2021年7月1日に、サブファンド・シャープパリティの名前はスーパーファンド・ジャパン・サブファンド・システムティック・オールウェザーに変更された。

以上に挙げた事象以外に、当社の財務諸表に係る調整若しくは開示を要する重要な事象は生じていないと経営陣は判断している。