

【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4年1月31日
- 【発行者名】 ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.
(Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg)
S.A.)
- 【代表者の役職氏名】 デュブティ・チーフ・エグゼクティブ・オフィサー 小林 央明
- 【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、アーロン通り
287 - 289番
(287-289, Route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)
- 【代理人の氏名又は名称】 弁護士 大西 信治
- 【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
- 【事務連絡者氏名】 弁護士 大西 信治
- 【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
- 【電話番号】 03(6212)8316
- 【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】
ニッセイ・ケイマン・トラスト
- JPX日経400ジャパン・ファンド
(Nissay Cayman Trust
- JPX Nikkei 400 Japan Fund)
- 【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券の金額】
米ドル建 米ドルヘッジクラス
30億アメリカ合衆国ドル(約3,413億円)を上限とする。
(注)アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)の円貨換算は、便宜上、
2021年11月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲
値(1米ドル=113.77円)による。
- 【縦覧に供する場所】 該当事項なし。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、2021年10月29日に提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)の関係情報を下表のとおり新たな情報により更新および追加するため、また、その他一部の情報を更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正の内容】

(1) 半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

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

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

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

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

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

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(2021年11月末日現在)

資産の種類	地域名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
株式	日本	23,585,808.66	95.85
現金・その他の資産 (負債控除後)		1,020,061.55	4.15
合計(純資産総額)		24,605,870.21 (約2,799百万円)	100.00

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

(注2) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)の円貨換算は、便宜上、2021年11月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=113.77円)による。以下、特に記載がない限り、米ドルの円金額表示はすべてこれによる。

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

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

投資資産

() 投資有価証券の主要銘柄

投資有価証券の主要銘柄(上位30銘柄)

(株式)

(2021年11月末日現在)

順位	銘柄	国名	業種	保有株数 (株)	取得価格 (米ドル)		時価 (米ドル)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
1	キーエンス	日本	電気機器	2,700	229.47	619,582.25	619.40	1,672,385.40	6.80
2	野村総合研究所	日本	情報・通信業	37,200	14.09	524,249.28	42.98	1,598,802.24	6.50
3	東京エレクトロン	日本	電気機器	2,900	195.92	568,180.90	527.02	1,528,345.59	6.21
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	235,600	6.12	1,442,875.64	5.30	1,247,873.93	5.07
5	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	69,500	15.62	1,085,290.24	17.61	1,224,184.24	4.98
6	ソニーグループ	日本	電気機器	9,200	72.28	664,971.64	121.76	1,120,172.62	4.55
7	日立製作所	日本	電気機器	15,900	54.75	870,527.02	58.90	936,537.94	3.81
8	リクルートホールディングス	日本	サービス業	14,400	30.31	436,471.32	60.78	875,198.38	3.56
9	東京海上ホールディングス	日本	保険業	15,200	45.81	696,354.81	50.27	764,116.43	3.11
10	富士通	日本	電気機器	4,500	158.11	711,501.47	165.53	744,880.88	3.03
11	日産化学	日本	化学	12,700	30.05	381,591.17	57.60	731,498.52	2.97
12	日本郵船	日本	海運業	11,200	42.60	477,120.98	65.17	729,930.86	2.97
13	信越化学工業	日本	化学	4,000	112.06	448,242.84	167.33	669,338.15	2.72
14	塩野義製薬	日本	医薬品	8,200	42.86	351,425.09	69.78	572,183.72	2.33
15	丸紅	日本	卸売業	57,800	8.97	518,752.68	8.96	517,957.64	2.11
16	HOYA	日本	精密機器	3,200	139.75	447,210.95	158.70	507,851.51	2.06
17	任天堂	日本	その他製品	1,100	387.30	426,033.46	441.23	485,358.23	1.97
18	中外製薬	日本	医薬品	14,000	36.74	514,367.82	32.41	453,740.81	1.84
19	KDDI	日本	情報・通信業	15,400	29.79	458,833.67	29.06	447,575.85	1.82
20	日本電産	日本	電気機器	3,900	50.13	195,506.56	114.49	446,519.00	1.81
21	ファナック	日本	電気機器	2,200	189.21	416,257.76	195.91	431,009.73	1.75
22	ベネフィット・ワン	日本	サービス業	8,900	11.76	104,690.74	46.85	416,997.67	1.69
23	大塚商会	日本	情報・通信業	9,100	29.80	271,167.63	45.71	415,949.62	1.69
24	シスメックス	日本	電気機器	3,300	97.61	322,118.26	124.71	411,537.28	1.67
25	パンダイナムコホールディングス	日本	その他製品	5,200	28.99	150,773.46	77.83	404,706.50	1.64
26	島津製作所	日本	精密機器	8,100	26.05	211,025.55	42.36	343,132.68	1.39
27	村田製作所	日本	電気機器	4,600	70.41	323,884.00	73.80	339,495.35	1.38
28	アドバンテスト	日本	電気機器	3,600	89.23	321,210.69	87.98	316,737.86	1.29
29	レーザーテック	日本	電気機器	1,200	226.35	271,619.88	261.97	314,359.95	1.28
30	ダイキン工業	日本	機械	1,500	138.51	207,761.95	203.88	305,825.88	1.24

- () 投資不動産物件
該当事項なし(2021年11月末日現在)。

- () その他投資資産の主要なもの
該当事項なし(2021年11月末日現在)。

(2) 運用実績

純資産の推移

2021年11月末日までの1年間における各月末の純資産の推移は以下のとおりである。

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2020年12月末日	32,437,593.00	3,690,425	0.012809	1.4573
2021年1月末日	31,044,715.80	3,531,957	0.012661	1.4404
2月末日	27,155,041.59	3,089,429	0.011230	1.2776
3月末日	26,616,874.32	3,028,202	0.011430	1.3004
4月末日	25,824,583.85	2,938,063	0.011199	1.2741
5月末日	26,204,046.51	2,981,234	0.011442	1.3018
6月末日	26,190,409.02	2,979,683	0.011502	1.3086
7月末日	25,381,546.47	2,887,659	0.011229	1.2775
8月末日	25,097,215.18	2,855,310	0.011297	1.2853
9月末日	25,526,962.22	2,904,202	0.011838	1.3468
10月末日	24,965,764.36	2,840,355	0.011789	1.3412
11月末日	24,605,870.21	2,799,410	0.011781	1.3403

< 参考情報 >

純資産総額および1万口当たり純資産価格の推移



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

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

分配の推移

2021年11月末日までの1年間の1口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

	1口当たり分配金	
	米ドル	円
2021年2月	0.0014	0.159278
2021年8月	0.0006	0.068262

< 参考情報 >

(2021年11月末日現在)
(単位:米ドル、1万口当たり課税前)

第1会計年度(2015年7月24日～2016年4月30日)	0.00
第2会計年度(2016年5月1日～2017年4月30日)	0.00
第3会計年度(2017年5月1日～2018年4月30日)	4.00
第4会計年度(2018年5月1日～2019年4月30日)	4.00
第5会計年度(2019年5月1日～2020年4月30日)	0.00
第6会計年度(2020年5月1日～2021年4月30日)	14.00
2021年2月	14.00
2021年8月	6.00
直近1年間累計	20.00
設定来累計	28.00

収益率の推移

計算期間	収益率(注)
2020年12月1日～2021年11月末日	10.11%

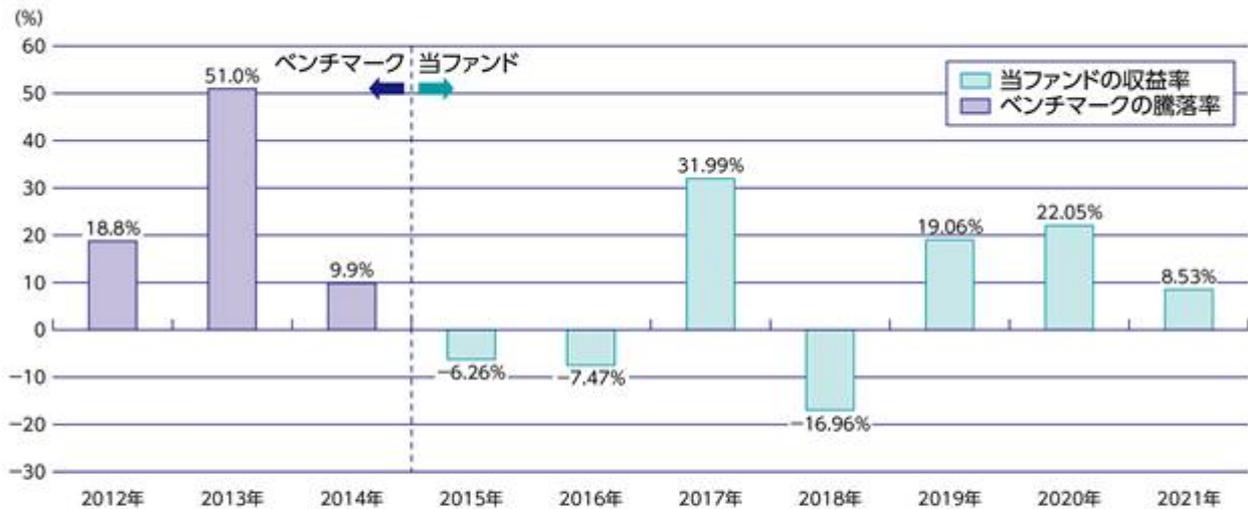
(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

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

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格(分配落ちの額)

< 参考情報 >

年間収益率の推移



(注1) 収益率(%)=100×(a-b)／b

a = 各暦年末現在の課税前分配金再投資換算受益証券1口当たり純資産価格

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

(注2) 当ファンドについて、2015年は7月24日(運用開始日)から12月末日までの収益率です。2021年は1月1日から11月末日までの収益率です。

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

2 販売及び買戻しの実績

2021年11月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2021年11月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

販売口数	買戻口数	発行済口数
92,967,402 (92,967,402)	599,163,410 (599,163,410)	2,088,524,847 (2,088,524,847)

(注) ()内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける諸法令および一般に認められた会計原則に準拠して作成された原文(英文)の中間財務書類を日本語に翻訳したものである(ただし、円換算部分を除く。)。ファンドの日本語の中間財務書類は、「中間財務諸表等の用語、様式および作成方法に関する規則」第76条第4項但書の規定に準拠して作成されている。
- b. ファンドの原文の中間財務書類は外国監査法人等(公認会計士法(昭和23年法律第103号)第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。)の監査を受けていない。
- c. ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について2021年11月30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=113.77円)で換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。円換算額は、四捨五入のため合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。

[次へ](#)

(1) 資産及び負債の状況

ニッセイ・ケイマン・トラスト
- J P X日経400ジャパン・ファンド
貸借対照表
2021年10月29日現在
(米ドルで表示)

	米ドル	千円
資産		
現金		130,455
銀行預金 - 基準通貨	0.03	0
銀行預金 - 外国通貨	1,146,655.14	130,455
有価証券、取得原価		1,899,357
株式、取得原価	16,694,707.91	1,899,357
未実現評価損益		803,811
未実現時価評価損益	7,364,630.99	837,874
未実現通貨運用評価損益	(294,381.72)	(33,492)
未実現通貨未決済評価損益	(1,316.00)	(150)
未実現通貨繰延評価損益	(3,703.79)	(421)
未収配当金		18,268
未収配当金	160,567.67	18,268
資産合計	25,067,160.23	2,851,891
負債		
受益証券		6,189
受益証券買戻未払金	54,396.92	6,189
未払費用		5,347
未払監査費用	10,907.60	1,241
未払報告書作成費用	3,326.40	378
未払投資顧問報酬	12,492.31	1,421
未払受託報酬	795.05	90
未払管理報酬	2,382.55	271
未払代行協会員報酬	991.30	113
未払販売報酬	13,877.62	1,579
未払ライセンス料	2,226.12	253
負債合計	101,395.87	11,536
資本		
ファンド受益証券		1,929,272
発行済ファンド受益証券(額面価額)		2,409,392
米ドル建 米ドルヘッジクラス	21,177,743.57	2,409,392
受益証券額面超過額	(4,220,091.22)	(480,120)
米ドル建 米ドルヘッジクラス	(4,220,091.22)	(480,120)
分配金支払額		(939,940)
分配金支払額	(8,261,753.74)	(939,940)
米ドル建 米ドルヘッジクラス	(8,261,753.74)	(939,940)
利益剰余金		1,548,313
利益剰余金	13,609,154.22	1,548,313
米ドル建 米ドルヘッジクラス	14,258,584.02	1,622,199
当期純利益	2,660,711.53	302,709
資本合計	24,965,764.36	2,840,355
負債および資本合計	25,067,160.23	2,851,891
純資産総額	24,965,764.36	2,840,355
発行済受益証券総数	2,117,774,357.00000	口
受益証券1口当たり純資産価格	0.011789	1円

ニッセイ・ケイマン・トラスト
- J P X日経400ジャパン・ファンド

損益計算書

2021年5月1日から2021年10月29日までの期間

(米ドルで表示)

	米ドル	千円
費用		
費用合計	0.00	0
収益		
実現損益	3,924,426.23	446,482
為替取引にかかる実現利益	2,214,400.06	251,932
米ドル建 米ドルヘッジクラス	2,214,212.65	251,911
為替取引にかかる実現損失	(1,002,943.64)	(114,105)
米ドル建 米ドルヘッジクラス	(1,002,009.83)	(113,999)
時価にかかる実現利益	3,073,125.46	349,629
時価にかかる実現損失	(193,257.04)	(21,987)
通貨にかかる実現利益	143,047.83	16,275
米ドル建 米ドルヘッジクラス	0.03	0
通貨にかかる実現損失	(309,946.44)	(35,263)
米ドル建 米ドルヘッジクラス	(0.02)	(0)
受取配当金	217,199.61	24,711
受取配当金	217,199.61	24,711
未実現評価損益	(1,221,314.67)	(138,949)
未実現時価評価損益	(520,063.98)	(59,168)
未実現通貨運用評価損益	(697,069.92)	(79,306)
米ドル建 米ドルヘッジクラス	(135,304.82)	(15,394)
未実現通貨繰延評価損益	(4,180.77)	(476)
収益合計	2,920,311.17	332,244
費用		
費用 - 報酬	226,335.57	25,750
監査費用	9,529.45	1,084
報告書作成費用	1,028.96	117
投資顧問報酬	79,913.79	9,092
受託報酬	4,986.80	567
管理報酬	15,315.52	1,742
代行協会員報酬	6,381.55	726
販売報酬	89,341.28	10,164
副保管報酬	10,690.52	1,216
C I M A 関連年次費用	7,871.30	896
ライセンス料	1,276.40	145
源泉徴収税	33,264.07	3,784
源泉徴収税	33,264.07	3,784
費用合計	259,599.64	29,535
投資純利益	2,660,711.53	302,709

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

保有有価証券残高明細表
ニッセイ・ケイマン・トラスト
- J P X日経400ジャパン・ファンド
種別・グループ別 2021年10月29日現在

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	価格/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	未実現損益		合計 (米ドル)
									時価 (米ドル)	通貨 (米ドル)	
株式											
基本素材											
3,400.00000	アイカ工業	27/07/2015		10,717,679	92,959.85	3,485.000000000c 114.025000000	11,849,000	103,915.81	9,921.69	1,034.27	10,955.96
12,700.00000	日産化学	22/01/2016		42,429,503	381,591.17	6,330.000000000c 114.025000000	80,391,000	705,029.60	332,922.58	-9,484.15	323,438.43
4,000.00000	信越化学工業	13/11/2017		49,368,647	448,242.84	20,255.000000000c 114.025000000	81,020,000	710,545.93	277,582.57	-15,279.48	262,303.09
20,100.00000	基本素材小計			102,515,829.00	922,793.86		173,260,000.00	1,519,491.34	620,426.84	-23,729.36	596,697.48
通信											
15,400.00000	K D D I	16/03/2020		50,916,966	458,833.67	3,528.000000000c 114.025000000	54,331,200	476,484.98	29,942.85	-12,291.54	17,651.31
5,100.00000	ソフトバンクグループ	08/08/2018		27,732,584	251,823.06	6,164.000000000c 114.025000000	31,436,400	275,697.43	32,482.49	-8,608.12	23,874.37
20,500.00000	通信小計			78,649,550.00	710,656.73		85,767,600.00	752,182.41	62,425.34	-20,899.66	41,525.68
耐久消費財											
7,700.00000	バンダイナムコホールディングス	27/07/2015		25,583,551	223,260.70	8,687.000000000c 114.025000000	66,889,900	586,624.86	362,256.95	1,107.21	363,364.16
200.00000	ファーストリテイリング	08/08/2018		11,378,847	103,554.25	75,510.000000000c 114.025000000	15,102,000	132,444.64	32,652.08	-3,761.69	28,890.39
57,800.00000	丸紅	28/05/2021		56,996,435	518,752.68	961.200012207c 114.025000000	55,557,361	487,238.42	-12,620.69	-18,893.57	-31,514.26
1,600.00000	任天堂	29/01/2020		66,893,296	619,685.04	50,200.000000000c 114.025000000	80,320,000	704,406.93	117,752.28	-33,030.39	84,721.89
9,200.00000	ソニーグループ	29/01/2020		72,114,483	664,971.64	13,140.000000000c 114.025000000	120,888,000	1,060,188.56	427,744.06	-32,527.15	395,216.91
69,500.00000	トヨタ自動車	26/03/2020		119,232,195	1,085,290.24	2,006.500000000c 114.025000000	139,451,750	1,222,992.76	177,325.63	-39,623.11	137,702.52
146,000.00000	耐久消費財小計			352,198,807.00	3,215,514.55		478,209,011.00	4,193,896.17	1,105,110.31	-126,728.70	978,381.61

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	価格/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	時価 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
株式											
非耐久消費財											
11,400.00000	ベネフィット・ワン	18/05/2017		14,685,494	134,098.24	5,750.000000000c 114.025000000	65,550,000	574,873.93	446,082.05	-5,306.36	440,775.69
14,000.00000	中外製薬	20/02/2020		56,043,375	514,367.82	4,247.000000000c 114.025000000	59,458,000	521,447.05	29,946.28	-22,867.05	7,079.23
1,600.00000	日本新薬	06/11/2020		13,653,027	126,939.96	9,110.000000000c 114.025000000	14,576,000	127,831.62	8,094.48	-7,202.82	891.66
14,400.00000	リクルートホールディングス	20/12/2018		48,564,102	436,471.32	7,572.000000000c 114.025000000	109,036,800	956,253.45	530,345.96	-10,563.83	519,782.13
8,100.00000	島津製作所	05/03/2020		22,825,577	211,025.55	4,615.000000000c 114.025000000	37,381,500	327,836.00	127,655.54	-10,845.09	116,810.45
8,200.00000	塩野義製薬	27/07/2015		41,565,782	351,425.09	7,407.000000000c 114.025000000	60,737,400	532,667.40	168,135.22	13,107.09	181,242.31
2,700.00000	シスメックス	11/04/2018		26,683,985	247,907.29	14,070.000000000c 114.025000000	37,989,000	333,163.78	99,145.06	-13,888.57	85,256.49
60,400.00000	非耐久消費財小計			224,021,342.00	2,022,235.27		384,728,700.00	3,374,073.23	1,409,404.59	-57,566.63	1,351,837.96
金融											
235,600.00000	三菱UFJフィナンシャル・グループ	13/12/2017		158,780,013	1,442,875.64	622.500000000c 114.025000000	146,661,000	1,286,217.93	-106,283.82	-50,373.88	-156,657.70
55,500.00000	野村ホールディングス	26/03/2021		37,448,419	342,720.99	550.000000000c 114.025000000	30,525,000	267,704.45	-60,718.43	-14,298.11	-75,016.54
15,200.00000	東京海上ホールディングス	07/12/2016		78,340,876	696,354.81	5,998.000000000c 114.025000000	91,169,600	799,557.99	112,507.99	-9,304.81	103,203.18
306,300.00000	金融小計			274,569,308.00	2,481,951.44		268,355,600.00	2,353,480.37	-54,494.26	-73,976.80	-128,471.06
工業											
2,700.00000	アドバンテスト	29/03/2021		26,657,247	243,366.15	9,330.000000000c 114.025000000	25,191,000	220,925.24	-12,859.00	-9,581.92	-22,440.92
1,500.00000	ダイキン工業	19/09/2019		22,392,955	207,761.95	24,890.000000000c 114.025000000	37,335,000	327,428.20	131,041.83	-11,375.59	119,666.24
2,200.00000	ファナック	22/01/2016		46,165,691	416,257.76	22,310.000000000c 114.025000000	49,082,000	430,449.46	25,576.05	-11,384.35	14,191.70
15,900.00000	日立製作所	01/06/2021		95,608,569	870,527.02	6,554.000000000c 114.025000000	104,208,600	913,910.11	75,422.33	-32,039.24	43,383.09
2,700.00000	HOYA	06/07/2021		40,983,902	369,979.00	16,725.000000000c 114.025000000	45,157,500	396,031.57	36,602.48	-10,549.91	26,052.57
2,700.00000	キーエンス	28/03/2016		66,308,786	619,582.25	68,510.000000000c 114.025000000	184,977,000	1,622,249.51	1,040,721.02	-38,053.76	1,002,667.26

口数/金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	価格/ 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	時価 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
株式											
工業											
9,700.00000	クボタ	27/07/2015		20,418,710	175,505.62	2,422.500000000c 114.025000000	23,498,250	206,079.81	27,007.59	3,566.60	30,574.19
4,600.00000	村田製作所	09/09/2020		34,932,012	323,884.00	8,653.000000000c 114.025000000	39,803,800	349,079.59	42,725.61	-17,530.02	25,195.59
3,900.00000	日本電産	13/11/2015		21,627,608	195,506.56	12,570.000000000c 114.025000000	49,023,000	429,932.03	240,257.77	-5,832.30	234,425.47
11,200.00000	日本郵船	17/05/2021		52,383,329	477,120.98	8,180.000000000c 114.025000000	91,616,000	803,472.92	344,070.78	-17,718.84	326,351.94
2,400.00000	オムロン	09/09/2020		20,560,704	189,607.53	10,870.000000000c 114.025000000	26,088,000	228,791.93	48,474.42	-9,290.02	39,184.40
22,600.00000	三和ホールディングス	27/07/2015		23,944,737	199,961.21	1,324.000000000c 114.025000000	29,922,400	262,419.64	52,424.14	10,034.29	62,458.43
4,700.00000	安川電機	27/07/2015		8,423,518	72,952.68	4,920.000000000c 114.025000000	23,124,000	202,797.63	128,923.32	921.63	129,844.95
86,800.00000	工業小計			480,407,768.00	4,362,012.71		729,026,550.00	6,393,567.64	2,180,388.34	-148,833.43	2,031,554.91
テクノロジー											
4,500.00000	富士通	17/03/2020		78,067,910	711,501.47	19,625.000000000c 114.025000000	88,312,500	774,501.21	89,845.12	-26,845.39	62,999.73
1,200.00000	レーザーテック	15/10/2021		30,884,539	271,619.88	25,030.000000000c 114.025000000	30,036,000	263,415.92	-7,441.69	-762.27	-8,203.96
37,200.00000	野村総合研究所	22/10/2015		60,555,566	524,249.28	4,540.000000000c 114.025000000	168,888,000	1,481,148.87	950,076.16	6,823.43	956,899.59
1,600.00000	オービック	28/10/2020		31,989,144	295,637.50	20,990.000000000c 114.025000000	33,584,000	294,531.90	13,986.90	-15,092.50	-1,105.60
9,100.00000	大塚商会	27/07/2015		30,250,625	271,167.63	5,600.000000000c 114.025000000	50,960,000	446,919.54	181,621.35	-5,869.45	175,751.90
10,800.00000	SUMCO	09/03/2020		22,041,172	204,603.96	2,164.000000000c 114.025000000	23,371,200	204,965.58	11,664.35	-11,302.74	361.61
7,000.00000	システナ	29/03/2021		14,571,765	132,582.73	2,096.000000000c 114.025000000	14,672,000	128,673.54	879.06	-4,788.26	-3,909.20
2,900.00000	東京エレクトロン	05/02/2018		62,110,932	568,180.90	52,850.000000000c 114.025000000	153,265,000	1,344,135.06	799,421.78	-23,467.62	775,954.16
74,300.00000	テクノロジー小計			330,471,653.00	2,979,543.35		563,088,700.00	4,938,291.62	2,040,053.03	-81,304.80	1,958,748.23
714,400.00000	株式合計			1,842,834,257.00	16,694,707.91		2,682,436,161.00	23,524,982.78	7,363,314.19	-533,039.38	6,830,274.81

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット クラス	取得原価 (表示通貨) (注1)	取得原価 (基準通貨) (注2) (米ドル)	価格 / 為替レート	価額 (表示通貨) (注1)	価額 (基準通貨) (注2) (米ドル)	時価 (米ドル)	通貨 (米ドル)	合計 (米ドル)
外貨建現金勘定											
非グループ化の有価証券											
1,356,395,170.00000	日本円		MultiLot	1,356,395,170	12,285,417.25	1.000000000s 114.025000000	1,356,395,170	11,895,594.56	0.00	-389,822.69	-389,822.69
-1,196,884,888.00000	日本円		MultiLot	-1,196,884,888	-11,138,762.11	1.000000000s 114.025000000	-1,196,884,888	-10,496,688.34	0.00	642,073.77	642,073.77
159,510,282.00000	非グループ化の有価証券小計			159,510,282.00	1,146,655.14		159,510,282.00	1,398,906.22	0.00	252,251.08	252,251.08
159,510,282.00000	外貨建現金勘定合計			159,510,282.00	1,146,655.14		159,510,282.00	1,398,906.22	0.00	252,251.08	252,251.08
先渡(ポジション)											
非グループ化の有価証券											
-6,214,663.00000	JPY FORWARD 02 NOV		MultiLot	-6,214,663	-54,396.92	1.000000000F 114.021942857	-6,214,663	-54,504.10	0.00	-107.18	-107.18
36,104,329.00000	JPY FORWARD 30 NOV		MultiLot	36,104,329	317,600.47	1.000000000F 113.971053333	36,104,329	316,785.08	0.00	-815.39	-815.39
-2,829,072,097.00000	JPY FORWARD 30 NOV	15/10/2021		-2,829,072,097	-24,810,053.99	1.000000000F 113.971053333	-2,829,072,097	-24,822,724.84	0.00	-12,670.85	-12,670.85
-2,799,182,431.00000	非グループ化の有価証券小計			-2,799,182,431.00	-24,546,850.44		-2,799,182,431.00	-24,560,443.86	0.00	-13,593.42	-13,593.42
-2,799,182,431.00000	先渡(ポジション)合計			-2,799,182,431.00	-24,546,850.44		-2,799,182,431.00	-24,560,443.86	0.00	-13,593.42	-13,593.42
-2,638,957,749.00000	投資明細合計			-796,837,892.00	-6,705,487.39		42,764,012.00	363,445.14	7,363,314.19	-294,381.72	7,068,932.47

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

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

[次へ](#)

4 管理会社の概況

(1) 資本金の額(2021年11月末日現在)

払込済資本金の額	187,117,965.90米ドル(約213億円)
発行済株式総数	5,051,655株

(2) 事業の内容及び営業の状況

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

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

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

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

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

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

管理会社は、2021年10月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っている。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産価額の合計
ケイマン諸島	アンブレラ・ファンドのサブ・ファンド	27	4,604,286,019.08米ドル

(3) その他

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

[次へ](#)

(2) その他の訂正

* _____の部分は訂正箇所を示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

< 訂正前 >

(前略)

(八) 資本金の額(2021年8月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約206億円)

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

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

(八) 資本金の額(2021年11月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約213億円)

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

(注)米ドルの円貨換算は、便宜上、2021年11月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場
の仲値(1米ドル=113.77円)による。

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

(後略)

4 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

(前略)

(A) 日本

2021年9月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

(A) 日本

2021年12月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)