

【表紙】

| | |
|---------------|---|
| 【提出書類】 | 半期報告書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 |
| 【提出日】 | 2023年1月31日 |
| 【計算期間】 | 第8期中(自 2022年5月1日 至 2022年10月31日) |
| 【ファンド名】 | 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) |
| 【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】 | エグゼクティブ・ディレクター ファブリス・マス (Fabrice Mas, Executive Director) |
| 【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 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項なし |

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

(2022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 | 19,798,665.35 | 95.61 |
| 現金・その他の資産 (負債控除後) | | 908,192.21 | 4.39 |
| 合計(純資産総額) | | 20,706,857.56 (約2,876百万円) | 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、2022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=138.87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)

(2022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 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本 | 銀行業 | 269,600 | 5.95 | 1,603,670.21 | 5.41 | 1,458,900.39 | 7.05 |
| 2 | 東京海上ホールディングス | 日本 | 保険業 | 61,400 | 16.86 | 1,035,365.67 | 20.26 | 1,243,928.62 | 6.01 |
| 3 | トヨタ自動車 | 日本 | 輸送用機器 | 79,800 | 15.85 | 1,264,492.69 | 14.41 | 1,149,762.79 | 5.55 |
| 4 | 日立製作所 | 日本 | 電気機器 | 21,000 | 54.46 | 1,143,727.76 | 52.31 | 1,098,459.22 | 5.30 |
| 5 | キーエンス | 日本 | 電気機器 | 2,100 | 258.11 | 542,032.56 | 409.49 | 859,925.47 | 4.15 |
| 6 | ソニーグループ | 日本 | 電気機器 | 8,800 | 74.80 | 658,275.12 | 80.66 | 709,789.31 | 3.43 |
| 7 | 丸紅 | 日本 | 卸売業 | 61,100 | 9.09 | 555,676.59 | 11.09 | 677,818.55 | 3.27 |
| 8 | 日本郵船 | 日本 | 海運業 | 30,900 | 16.35 | 505,231.88 | 21.76 | 672,518.99 | 3.25 |
| 9 | 富士通 | 日本 | 電気機器 | 4,800 | 154.22 | 740,235.61 | 132.33 | 635,172.71 | 3.07 |
| 10 | 日産化学 | 日本 | 化学 | 13,000 | 33.71 | 438,246.47 | 48.30 | 627,920.31 | 3.03 |
| 11 | 三井住友フィナンシャルグループ | 日本 | 銀行業 | 17,200 | 36.09 | 620,683.86 | 33.49 | 576,004.01 | 2.78 |
| 12 | 信越化学工業 | 日本 | 化学 | 4,400 | 116.98 | 514,705.78 | 125.91 | 554,020.35 | 2.68 |
| 13 | H O Y A | 日本 | 精密機器 | 5,300 | 120.18 | 636,977.67 | 100.76 | 534,026.09 | 2.58 |
| 14 | K D D I | 日本 | 情報・通信業 | 17,300 | 30.46 | 526,899.64 | 29.46 | 509,676.80 | 2.46 |
| 15 | 任天堂 | 日本 | その他製品 | 11,700 | 39.78 | 465,448.93 | 42.24 | 494,193.78 | 2.39 |
| 16 | 日本電信電話 | 日本 | 情報・通信業 | 17,800 | 28.85 | 513,548.30 | 27.38 | 487,286.80 | 2.35 |
| 17 | 第一三共 | 日本 | 医薬品 | 13,800 | 29.52 | 407,433.44 | 32.38 | 446,813.82 | 2.16 |
| 18 | 塩野義製薬 | 日本 | 医薬品 | 8,400 | 44.22 | 371,441.69 | 49.81 | 418,374.66 | 2.02 |
| 19 | 中外製薬 | 日本 | 医薬品 | 15,800 | 34.61 | 546,822.09 | 25.97 | 410,342.55 | 1.98 |
| 20 | 三井物産 | 日本 | 卸売業 | 13,600 | 24.74 | 336,397.70 | 28.54 | 388,195.50 | 1.87 |
| 21 | リクルートホールディングス | 日本 | サービス業 | 12,500 | 31.24 | 390,529.27 | 31.02 | 387,792.03 | 1.87 |
| 22 | 伊藤忠商事 | 日本 | 卸売業 | 12,400 | 29.35 | 363,948.98 | 30.72 | 380,957.43 | 1.84 |
| 23 | パンダイナムコホールディングス | 日本 | その他製品 | 5,600 | 38.64 | 216,407.18 | 64.82 | 362,992.69 | 1.75 |
| 24 | ロート製薬 | 日本 | 医薬品 | 10,700 | 28.93 | 309,565.98 | 32.18 | 344,295.54 | 1.66 |
| 25 | ファナック | 日本 | 電気機器 | 2,200 | 184.09 | 404,997.35 | 145.94 | 321,076.39 | 1.55 |
| 26 | ダイキン工業 | 日本 | 機械 | 1,900 | 151.75 | 288,324.78 | 160.56 | 305,070.23 | 1.47 |
| 27 | 東京エレクトロン | 日本 | 電気機器 | 900 | 237.33 | 213,594.82 | 323.13 | 290,819.84 | 1.40 |
| 28 | ルネサスエレクトロニクス | 日本 | 電気機器 | 30,500 | 12.15 | 370,447.24 | 9.43 | 287,645.12 | 1.39 |
| 29 | オービック | 日本 | 情報・通信業 | 1,700 | 178.09 | 302,746.18 | 155.51 | 264,368.64 | 1.28 |
| 30 | 野村総合研究所 | 日本 | 情報・通信業 | 11,800 | 16.42 | 193,732.57 | 21.47 | 253,352.44 | 1.22 |

() 投資不動産物件

該当事項なし(2022年11月末日現在)。

() その他投資資産の主要なものの

該当事項なし(2022年11月末日現在)。

(2) 【運用実績】

【純資産の推移】

2022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 |
| 2021年12月末日 | 25,450,993.24 | 3,534,379 | 0.012265 | 1.7032 |
| 2022年1月末日 | 23,068,903.94 | 3,203,579 | 0.011175 | 1.5519 |
| 2月末日 | 21,356,862.91 | 2,965,828 | 0.010381 | 1.4416 |
| 3月末日 | 22,966,347.36 | 3,189,337 | 0.011022 | 1.5306 |
| 4月末日 | 22,094,042.71 | 3,068,200 | 0.010605 | 1.4727 |
| 5月末日 | 22,291,763.34 | 3,095,657 | 0.010796 | 1.4992 |
| 6月末日 | 20,949,752.19 | 2,909,292 | 0.010140 | 1.4081 |
| 7月末日 | 21,906,223.11 | 3,042,117 | 0.010618 | 1.4745 |
| 8月末日 | 21,296,730.17 | 2,957,477 | 0.010408 | 1.4454 |
| 9月末日 | 19,500,221.22 | 2,707,996 | 0.009701 | 1.3472 |
| 10月末日 | 20,326,347.08 | 2,822,720 | 0.010299 | 1.4302 |
| 11月末日 | 20,706,857.56 | 2,875,561 | 0.010780 | 1.4970 |

<参考情報>



(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】

2022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 |
| 2022年2月 | 0.0007 | 0.097209 |
| 2022年8月 | 0.0002 | 0.027774 |

<参考情報>

(2022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 |
| 第7会計年度(2021年5月1日～2022年4月30日) | 13.00 |
| 2022年2月 | 7.00 |
| 2022年8月 | 2.00 |
| 直近1年間累計 | 9.00 |
| 設定来累計 | 37.00 |

【収益率の推移】

| 計算期間 | 収益率(注) |
|-----------------------|--------|
| 2021年12月1日～2022年11月末日 | -0.86% |

(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>

年間收益率の推移



(注1) 収益率(%) = $100 \times (a-b) / b$

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月末日までの收益率です。2022年は1月1日から11月末日までの
收益率です。

(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】

2022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2022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 | 買戻し口数 | 発行済口数 |
|----------------------------|------------------------------|----------------------------------|
| 80,277,418 (80,277,418) | 247,887,491 (247,887,491) | 1,920,914,774 (1,920,914,774) |

(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。

3 【ファンドの経理状況】

- a . ファンドの日本文の中間財務書類は、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。）。ファンドの日本文の中間財務書類は、「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。日本文の中間財務書類には、主要な金額について2022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=138.87円）で換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。円換算額は、四捨五入のため合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。

(1) 【資産及び負債の状況】

ニッセイ・ケイマン・トラスト
- JPX日経400ジャパン・ファンド
純資産計算書
2022年10月31日現在
(米ドルで表示)

| | 米ドル | 千円 |
|----------------|-----------------|--------------|
| 資産 | | |
| 投資有価証券(ロング) | | |
| 普通株式 | 18,398,473.81 | 2,554,996 |
| 現金(ロング) | | |
| 現金および現金等価物 | 1,910,506.80 | 265,312 |
| 未収配当金 | | |
| 未収配当金 | 245,690.07 | 34,119 |
| 為替予約取引未収金 | | |
| 為替予約取引未収金 | 20,269,876.62 | 2,814,878 |
| 未収金 | | |
| 未収金 | (4.09) | (1) |
| スポット為替取引未収金 | | |
| スポット為替取引未収金 | 33,788.50 | 4,692 |
| 未払源泉徴収税 | | |
| 未払源泉徴収税 | (37,627.44) | (5,225) |
| 資産合計 | 40,820,704.27 | 5,668,771 |
| 負債 | | |
| 未払代行協会員報酬 | | |
| 未払代行協会員報酬 | (3,558.97) | (494) |
| 未払監査報酬 | | |
| 未払監査報酬 | (31,290.15) | (4,345) |
| 未払買戻し | | |
| 未払買戻し | (35,444.50) | (4,922) |
| 未払販売報酬 | | |
| 未払販売報酬 | (49,823.53) | (6,919) |
| 為替予約取引未払金 | | |
| 為替予約取引未払金 | (20,257,177.10) | (2,813,114) |
| 未払ライセンス料 | | |
| 未払ライセンス料 | (2,127.94) | (296) |
| 未払管理会社報酬 | | |
| 未払管理会社報酬 | (29,464.87) | (4,092) |
| 未払投資顧問報酬 | | |
| 未払投資顧問報酬 | (44,843.67) | (6,227) |
| 未払金 | | |
| 未払金 | 4,356.60 | 605 |
| 未払報告書作成費用 | | |
| 未払報告書作成費用 | (5,404.41) | (751) |
| スポット為替取引未払金 | | |
| スポット為替取引未払金 | (33,714.62) | (4,682) |
| 未払受託報酬 | | |
| 未払受託報酬 | (5,864.03) | (814) |
| 負債合計 | (20,494,357.19) | (2,846,051) |
| 純資産総額 | 20,326,347.08 | 2,822,720 |
| 純資産価額 | | |
| 米ドル建 米ドルヘッジクラス | 20,326,347.08 | 2,822,720 千円 |
| 発行済口数 | | |
| 米ドル建 米ドルヘッジクラス | 1,973,679,258 口 | |
| 1口当たり純資産価格 | | |
| 米ドル建 米ドルヘッジクラス | 0.010299 | 1 円 |

ニッセイ・ケイマン・トラスト
- JPX日経400ジャパン・ファンド
運用計算書
2022年5月1日から2022年10月31日までの期間
(米ドルで表示)

| | 米ドル | 千円 |
|--------------------------|----------------|-----------|
| 収益 | 310,234.10 | 43,082 |
| 受取配当金 | 310,234.10 | 43,082 |
| | 普通株式 | 43,082 |
| 費用 | (655,788.79) | (91,069) |
| 代行協会員報酬 | (5,410.79) | (751) |
| | 現金および現金等価物 | (751) |
| 監査報酬 | (9,876.35) | (1,372) |
| | 現金および現金等価物 | (1,372) |
| 販売報酬 | (75,750.65) | (10,519) |
| | 現金および現金等価物 | (10,519) |
| 配当金源泉徴収税費用 | (47,512.35) | (6,598) |
| | 普通株式 | (6,598) |
| 宣言済分配金 | (412,096.51) | (57,228) |
| | 現金および現金等価物 | (57,228) |
| 弁護士および専門家報酬 | (3,872.39) | (538) |
| | 現金および現金等価物 | (538) |
| 弁護士報酬 | (5,423.36) | (753) |
| | 現金および現金等価物 | (753) |
| ライセンス料 | (1,080.18) | (150) |
| | 現金および現金等価物 | (150) |
| 管理会社報酬 | (12,985.82) | (1,803) |
| | 現金および現金等価物 | (1,803) |
| 投資顧問報酬 | (68,175.57) | (9,468) |
| | 現金および現金等価物 | (9,468) |
| 報告書および財務書類作成費用 | (1,032.23) | (143) |
| | 現金および現金等価物 | (143) |
| 副保管報酬 | (7,476.50) | (1,038) |
| | 現金および現金等価物 | (1,038) |
| 受託報酬 | (5,096.09) | (708) |
| | 現金および現金等価物 | (708) |
| 投資に係る実現および未実現損益 | (301,781.02) | (41,908) |
| 為替取引に係る未実現損益の変動 | (2,374,862.85) | (329,797) |
| | 現金および現金等価物 | 1,687 |
| | 普通株式 | (212,659) |
| | 為替予約取引 | (118,826) |
| 価格に係る未実現損益の変動 | (1,246,246.44) | (173,066) |
| | 普通株式 | (173,066) |
| 長期通貨に係る損益 | (562,023.76) | (78,048) |
| | 普通株式 | (78,048) |
| 長期価格に係る損益 | 300,430.59 | 41,721 |
| | 普通株式 | 41,721 |
| サブ・ファンドの基準通貨以外の為替に係る実現損失 | (1,695,293.49) | (235,425) |
| | 現金および現金等価物 | (40,515) |
| | 為替予約取引 | (194,910) |
| サブ・ファンドの基準通貨以外の為替に係る実現利益 | 5,276,214.93 | 732,708 |
| | 現金および現金等価物 | 19,639 |
| | 為替予約取引 | 713,069 |
| 純損益 | (647,335.71) | (89,896) |

(2)【投資有価証券明細表等】

ニッセイ・ケイマン・トラスト
- JPX日経400ジャパン・ファンド
投資ポジション評価明細表
2022年10月31日現在

| 種類 | 投資ID | 数量 | 価格 (現地通貨) | 取得原価 (現地通貨) | 帳簿上の 取得原価 | 帳簿上の 未実現損益 | 経過 利息 | 帳簿上の 時価 | 投資 比率 |
|--|------------|-------------------|--------------|----------------|--------------|---------------|---------------|--------------|----------|
| 投資 | | | | 21,785,068.70 | 1,476,088.09 | 0.00 | 20,308,980.61 | 100.00% | |
| 現金(ロング) | | | | 1,910,506.80 | 0.00 | 0.00 | 1,910,506.80 | 9.41% | |
| 現金および現 金等価物 | | | | 1,910,506.80 | 0.00 | 0.00 | 1,910,506.80 | 9.41% | |
| 日本円 | | | | 1,870,282.36 | 0.00 | 0.00 | 1,870,282.36 | 9.21% | |
| 日本円 | JPY | 277,989,418.25000 | 1.0000 | 277,989,418.25 | 1,870,282.36 | 0.00 | 1,870,282.36 | 9.21% | |
| 米ドル | | | | 40,224.44 | 0.00 | 0.00 | 40,224.44 | 0.20% | |
| 米ドル | USD | 40,224.44000 | 1.0000 | 40,224.44 | 40,224.44 | 0.00 | 40,224.44 | 0.20% | |
| 投資有価証券 (ロング) | | | | 19,874,561.90 | 1,476,088.09 | 0.00 | 18,398,473.81 | 90.59% | |
| 普通株式 | | | | 19,874,561.90 | 1,476,088.09 | 0.00 | 18,398,473.81 | 90.59% | |
| 日本円 | | | | 19,874,561.90 | 1,476,088.09 | 0.00 | 18,398,473.81 | 90.59% | |
| アドバン テスト パンダイ ナムコ ホール ディング ス | 6857 JP | 2,800.00000 | 7,860.0000 | 25,813,385.49 | 217,286.40 | -69,218.99 | 0.00 | 148,067.41 | 0.73% |
| カルビー | 7832 JP | 5,800.00000 | 9,842.0000 | 26,181,720.70 | 215,390.41 | 168,661.80 | 0.00 | 384,052.21 | 1.89% |
| 中外製薬 | 2229 JP | 3,300.00000 | 2,985.0000 | 9,104,849.50 | 63,671.34 | 2,601.75 | 0.00 | 66,273.09 | 0.33% |
| 第一三共 | 4519 JP | 16,300.00000 | 3,450.0000 | 64,670,252.52 | 574,267.77 | -195,924.85 | 0.00 | 378,342.92 | 1.86% |
| ダイキン 工業 | 4568 JP | 14,200.00000 | 4,767.0000 | 59,518,515.80 | 416,898.66 | 38,521.66 | 0.00 | 455,420.32 | 2.24% |
| ファナッ ク | 6367 JP | 2,000.00000 | 22,385.0000 | 34,827,720.20 | 302,809.61 | -1,601.95 | 0.00 | 301,207.66 | 1.48% |
| ファース トリティ リング | 6954 JP | 2,300.00000 | 19,630.0000 | 48,501,010.90 | 428,060.18 | -124,302.65 | 0.00 | 303,757.53 | 1.50% |
| 富士電機 | 9983 JP | 400.00000 | 82,990.0000 | 27,942,818.42 | 218,601.80 | 4,737.25 | 0.00 | 223,339.05 | 1.10% |
| 富士通 | 6504 JP | 5,600.00000 | 5,760.0000 | 34,721,653.72 | 296,718.99 | -79,704.16 | 0.00 | 217,014.83 | 1.07% |
| 日立製作 所 | 6702 JP | 4,900.00000 | 17,125.0000 | 86,588,855.99 | 765,530.97 | -200,976.86 | 0.00 | 564,554.11 | 2.78% |
| H O Y A | 6501 JP | 21,700.00000 | 6,760.0000 | 135,548,108.07 | 1,188,574.95 | -201,647.24 | 0.00 | 986,927.71 | 4.86% |
| I H I | 7741 JP | 5,500.00000 | 13,875.0000 | 82,024,382.83 | 668,846.25 | -155,424.11 | 0.00 | 513,422.14 | 2.53% |
| 伊藤忠商 事 | 7013 JP | 4,000.00000 | 3,320.0000 | 15,306,150.80 | 106,311.17 | -16,964.78 | 0.00 | 89,346.39 | 0.44% |
| J F E | 8001 JP | 12,800.00000 | 3,849.0000 | 49,390,989.03 | 376,148.18 | -44,683.85 | 0.00 | 331,464.33 | 1.63% |
| ホール ディング ス | 5411 JP | 14,000.00000 | 1,363.0000 | 20,712,825.78 | 157,736.98 | -29,355.37 | 0.00 | 128,381.61 | 0.63% |
| K D D I | 9433 JP | 17,800.00000 | 4,395.0000 | 62,569,403.55 | 542,989.06 | -16,659.46 | 0.00 | 526,329.60 | 2.59% |
| キーエン ス | 6861 JP | 2,200.00000 | 56,320.0000 | 62,221,470.59 | 553,993.55 | 279,618.99 | 0.00 | 833,612.54 | 4.10% |
| 寿スピ リッツ | 2222 JP | 900.00000 | 7,630.0000 | 7,102,923.66 | 49,531.64 | -3,331.22 | 0.00 | 46,200.42 | 0.23% |
| クボタ | 6326 JP | 10,200.00000 | 2,076.5000 | 21,656,665.99 | 182,708.90 | -40,210.16 | 0.00 | 142,498.74 | 0.70% |
| レーザー テック | 6920 JP | 1,100.00000 | 21,290.0000 | 26,188,152.83 | 223,900.46 | -66,339.99 | 0.00 | 157,560.47 | 0.78% |
| 丸紅 | 8002 JP | 62,900.00000 | 1,303.0000 | 64,930,924.70 | 569,305.49 | -17,896.33 | 0.00 | 551,409.16 | 2.72% |
| 三菱地所 | 8802 JP | 15,100.00000 | 1,873.0000 | 30,026,640.00 | 222,170.66 | -31,890.44 | 0.00 | 190,280.22 | 0.94% |
| 三菱UF Jフィナ ンシャル ・グル ープ | 8306 JP | 277,500.00000 | 699.5000 | 189,754,319.63 | 1,667,647.09 | -361,687.86 | 0.00 | 1,305,959.23 | 6.43% |

| 種類 | 投資ID | 数量 | 価格 (現地通貨) | 取得原価 (現地通貨) | 帳簿上の 取得原価 | 帳簿上の 未実現損益 | 経過 利息 | 帳簿上の 時価 | 投資 比率 |
|------------------|---------|------------------|--------------|----------------|---------------|---------------|----------|---------------|----------|
| 三井物産 | 8031 JP | 14,000.00000 | 3,293.0000 | 45,494,224.47 | 345,823.48 | -35,654.27 | 0.00 | 310,169.21 | 1.53% |
| 村田製作所 | 6981 JP | 4,800.00000 | 7,300.0000 | 36,801,155.81 | 331,749.47 | -96,004.19 | 0.00 | 235,745.28 | 1.16% |
| 日本電産 | 6594 JP | 4,300.00000 | 8,238.0000 | 26,674,402.95 | 229,038.84 | 9,285.92 | 0.00 | 238,324.76 | 1.17% |
| 任天堂 | 7974 JP | 12,000.00000 | 6,070.0000 | 53,658,814.00 | 474,997.55 | 15,061.99 | 0.00 | 490,059.54 | 2.41% |
| 日本電信電話 | 9432 JP | 18,300.00000 | 4,094.0000 | 61,936,107.28 | 529,347.38 | -25,292.48 | 0.00 | 504,054.90 | 2.48% |
| 日本郵船 | 9101 JP | 31,800.00000 | 2,699.0000 | 59,627,894.05 | 516,531.86 | 60,910.87 | 0.00 | 577,442.73 | 2.84% |
| 日産化学 | 4021 JP | 13,300.00000 | 6,700.0000 | 50,906,982.08 | 439,418.35 | 160,103.97 | 0.00 | 599,522.32 | 2.95% |
| 野村総合研究所 | 4307 JP | 12,100.00000 | 3,305.0000 | 23,354,769.78 | 194,851.09 | 74,200.61 | 0.00 | 269,051.70 | 1.32% |
| オービック | 4684 JP | 1,700.00000 | 22,370.0000 | 34,155,854.58 | 305,753.58 | -49,898.63 | 0.00 | 255,854.95 | 1.26% |
| リクルートホールディングス | 6098 JP | 12,900.00000 | 4,590.0000 | 46,289,947.76 | 402,889.60 | -4,524.48 | 0.00 | 398,365.12 | 1.96% |
| ルネサスエルクトロニクス | 6723 JP | 31,400.00000 | 1,246.5000 | 45,491,412.30 | 387,269.25 | 123,938.94 | 0.00 | 263,330.31 | 1.30% |
| ロート製薬 | 4527 JP | 11,000.00000 | 4,625.0000 | 43,544,004.45 | 317,079.89 | 25,201.54 | 0.00 | 342,281.43 | 1.69% |
| 島津製作所 | 7701 JP | 5,400.00000 | 3,925.0000 | 16,687,994.00 | 147,994.20 | -5,396.56 | 0.00 | 142,597.64 | 0.70% |
| 信越化学工業 | 4063 JP | 4,500.00000 | 15,540.0000 | 60,713,737.57 | 528,597.12 | -58,115.74 | 0.00 | 470,481.38 | 2.32% |
| 塙野義製薬 | 4507 JP | 8,600.00000 | 6,890.0000 | 45,753,916.25 | 379,329.08 | 19,325.34 | 0.00 | 398,654.42 | 1.96% |
| ソフトバンクグループ | 9984 JP | 5,400.00000 | 6,400.0000 | 29,451,460.69 | 260,723.18 | -28,207.29 | 0.00 | 232,515.89 | 1.14% |
| ソニーグループ | 6758 JP | 9,100.00000 | 9,988.0000 | 77,031,287.93 | 679,357.53 | -67,854.18 | 0.00 | 611,503.35 | 3.01% |
| 三井住友ファイナンシャルグループ | 8316 JP | 17,700.00000 | 4,173.0000 | 75,259,978.26 | 645,265.86 | 148,329.74 | 0.00 | 496,936.12 | 2.45% |
| 東京海上ホールディングス | 8766 JP | 63,300.00000 | 2,691.0000 | 124,150,866.77 | 1,059,423.25 | 86,607.63 | 0.00 | 1,146,030.88 | 5.64% |
| 東京エレクトロン | 8035 JP | 900.00000 | 39,490.0000 | 24,163,539.00 | 209,314.93 | 29,801.03 | 0.00 | 239,115.96 | 1.18% |
| トヨタ自動車 | 7203 JP | 82,200.00000 | 2,059.5000 | 150,042,629.57 | 1,312,326.04 | 173,355.41 | 0.00 | 1,138,970.63 | 5.61% |
| ユニ・チャーム | 8113 JP | 3,200.00000 | 4,532.0000 | 15,248,455.11 | 106,582.31 | -9,011.75 | 0.00 | 97,570.56 | 0.48% |
| 安川電機 | 6506 JP | 3,400.00000 | 4,130.0000 | 7,431,733.23 | 61,797.55 | 32,675.49 | 0.00 | 94,473.04 | 0.47% |
| 未収金 | | | | | 20,517,491.79 | -5,768.13 | 0.00 | 20,511,723.66 | 100.00% |
| 未収配当金 | | | | | 252,630.94 | -6,940.87 | 0.00 | 245,690.07 | 1.20% |
| 現金および現金等価物 | | | | | 252,630.94 | -6,940.87 | 0.00 | 245,690.07 | 1.20% |
| 日本円 | | | | | 252,630.94 | -6,940.87 | 0.00 | 245,690.07 | 1.20% |
| 日本円 | JPY | 36,518,146.00000 | 1.0000 | 36,518,146.00 | 252,630.94 | -6,940.87 | 0.00 | 245,690.07 | 1.20% |
| 為替予約取引未収金 | | | | | 20,269,762.76 | 113.86 | 0.00 | 20,269,876.62 | 98.82% |
| 為替予約取引 | | | | | 20,269,762.76 | 113.86 | 0.00 | 20,269,876.62 | 98.82% |
| 日本円 | | | | | 187,302.20 | 113.86 | 0.00 | 187,416.06 | 0.91% |
| JPY.FWD | JPY.FWD | 27,764,483.00000 | 1.0000 | 27,764,483.00 | 187,302.20 | 113.86 | 0.00 | 187,416.06 | 0.91% |
| 米ドル | | | | | 20,082,460.56 | 0.00 | 0.00 | 20,082,460.56 | 97.91% |
| USD.FWD | USD.FWD | 20,082,460.56000 | 1.0000 | 20,082,460.56 | 20,082,460.56 | 0.00 | 0.00 | 20,082,460.56 | 97.91% |
| 未収金 | | | | | 0.00 | -4.09 | 0.00 | -4.09 | 0.00% |
| 現金および現金等価物 | | | | | 0.00 | -4.09 | 0.00 | -4.09 | 0.00% |
| 日本円 | | | | | 0.00 | -4.09 | 0.00 | -4.09 | 0.00% |
| 日本円 | JPY | 0.00000 | NA | 0.00 | 0.00 | -4.09 | 0.00 | -4.09 | 0.00% |
| スポット為替取引未収金 | | | | | 33,788.50 | 0.00 | 0.00 | 33,788.50 | 0.16% |
| 現金および現金等価物 | | | | | 33,788.50 | 0.00 | 0.00 | 33,788.50 | 0.16% |
| 米ドル | | | | | 33,788.50 | 0.00 | 0.00 | 33,788.50 | 0.16% |
| 米ドル | USD | 33,788.50000 | 1.0000 | 33,788.50 | 33,788.50 | 0.00 | 0.00 | 33,788.50 | 0.16% |

| 種類 | 投資ID | 数量 | 価格 (現地通貨) | 取得原価 (現地通貨) | 帳簿上の 取得原価 | 帳簿上の 未実現損益 | 経過 利息 | 帳簿上の 時価 | 投資 比率 |
|------------|---------|---------------------|--------------|------------------|---------------|---------------|----------|---------------|----------|
| 未払源泉徴収税 | | | | | -38,690.41 | 1,062.97 | 0.00 | -37,627.44 | -0.18% |
| 現金および現金等価物 | | | | | -38,690.41 | 1,062.97 | 0.00 | -37,627.44 | -0.18% |
| 日本円 | | | | | -38,690.41 | 1,062.97 | 0.00 | -37,627.44 | -0.18% |
| 日本円 | JPY | -5,592,754.09000 | 1.0000 | -5,592,754.09 | -38,690.41 | 1,062.97 | 0.00 | -37,627.44 | -0.18% |
| 未払金 | | | | | 20,511,373.33 | 17,016.14 | 0.00 | 20,494,357.19 | 100.00% |
| 未払代行協会員報酬 | | | | | -3,558.97 | 0.00 | 0.00 | -3,558.97 | 0.02% |
| 現金および現金等価物 | | | | | -3,558.97 | 0.00 | 0.00 | -3,558.97 | 0.02% |
| 米ドル | | | | | -3,558.97 | 0.00 | 0.00 | -3,558.97 | 0.02% |
| 米ドル | USD | -3,558.97000 | 1.0000 | -3,558.97 | -3,558.97 | 0.00 | 0.00 | -3,558.97 | 0.02% |
| 未払監査報酬 | | | | | -31,290.15 | 0.00 | 0.00 | -31,290.15 | 0.15% |
| 現金および現金等価物 | | | | | -31,290.15 | 0.00 | 0.00 | -31,290.15 | 0.15% |
| ユーロ | | | | | -31,290.15 | 0.00 | 0.00 | -31,290.15 | 0.15% |
| ユーロ | EUR | -28,429.12000 | 1.0000 | -28,429.12 | -31,290.15 | 0.00 | 0.00 | -31,290.15 | 0.15% |
| 未払資本 | | | | | -35,444.50 | 0.00 | 0.00 | -35,444.50 | 0.17% |
| 現金および現金等価物 | | | | | -35,444.50 | 0.00 | 0.00 | -35,444.50 | 0.17% |
| 米ドル | | | | | -35,444.50 | 0.00 | 0.00 | -35,444.50 | 0.17% |
| 米ドル | USD | -35,444.50000 | 1.0000 | -35,444.50 | -35,444.50 | 0.00 | 0.00 | -35,444.50 | 0.17% |
| 未払販売報酬 | | | | | -49,823.53 | 0.00 | 0.00 | -49,823.53 | 0.24% |
| 現金および現金等価物 | | | | | -49,823.53 | 0.00 | 0.00 | -49,823.53 | 0.24% |
| 米ドル | | | | | -49,823.53 | 0.00 | 0.00 | -49,823.53 | 0.24% |
| 米ドル | USD | -49,823.53000 | 1.0000 | -49,823.53 | -49,823.53 | 0.00 | 0.00 | -49,823.53 | 0.24% |
| 為替予約取引未払金 | | | | | 20,269,762.76 | 12,585.66 | 0.00 | 20,257,177.10 | 98.84% |
| 為替予約取引 | | | | | 20,269,762.76 | 12,585.66 | 0.00 | 20,257,177.10 | 98.84% |
| 日本円 | | | | | 20,082,460.56 | 12,585.66 | 0.00 | 20,069,874.90 | 97.93% |
| JPY.FWD | JPY.FWD | 2,973,226,953.00000 | 1.0000 | 2,973,226,953.00 | 20,082,460.56 | 12,585.66 | 0.00 | 20,069,874.90 | 97.93% |
| 米ドル | | | | | -187,302.20 | 0.00 | 0.00 | -187,302.20 | 0.91% |
| USD.FWD | USD.FWD | -187,302.20000 | 1.0000 | -187,302.20 | -187,302.20 | 0.00 | 0.00 | -187,302.20 | 0.91% |
| 未払ライセンス料 | | | | | -2,127.94 | 0.00 | 0.00 | -2,127.94 | 0.01% |
| 現金および現金等価物 | | | | | -2,127.94 | 0.00 | 0.00 | -2,127.94 | 0.01% |
| 日本円 | | | | | -2,127.94 | 0.00 | 0.00 | -2,127.94 | 0.01% |
| 日本円 | JPY | -241,420.00000 | 1.0000 | -241,420.00 | -2,127.94 | 0.00 | 0.00 | -2,127.94 | 0.01% |
| 未払管理会社報酬 | | | | | -29,464.87 | 0.00 | 0.00 | -29,464.87 | 0.14% |
| 現金および現金等価物 | | | | | -29,464.87 | 0.00 | 0.00 | -29,464.87 | 0.14% |
| 米ドル | | | | | -29,464.87 | 0.00 | 0.00 | -29,464.87 | 0.14% |
| 米ドル | USD | -29,464.87000 | 1.0000 | -29,464.87 | -29,464.87 | 0.00 | 0.00 | -29,464.87 | 0.14% |
| 未払投資顧問報酬 | | | | | -44,843.67 | 0.00 | 0.00 | -44,843.67 | 0.22% |
| 現金および現金等価物 | | | | | -44,843.67 | 0.00 | 0.00 | -44,843.67 | 0.22% |
| 米ドル | | | | | -44,843.67 | 0.00 | 0.00 | -44,843.67 | 0.22% |
| 米ドル | USD | -44,843.67000 | 1.0000 | -44,843.67 | -44,843.67 | 0.00 | 0.00 | -44,843.67 | 0.22% |
| 未払金 | | | | | 0.00 | 4,356.60 | 0.00 | 4,356.60 | -0.02% |
| 現金および現金等価物 | | | | | 0.00 | 4,356.60 | 0.00 | 4,356.60 | -0.02% |
| ユーロ | | | | | 0.00 | 3,848.82 | 0.00 | 3,848.82 | -0.02% |
| ユーロ | EUR | 0.00000 | NA | 0.00 | 0.00 | 3,848.82 | 0.00 | 3,848.82 | -0.02% |
| 日本円 | | | | | 0.00 | 507.78 | 0.00 | 507.78 | 0.00% |
| 日本円 | JPY | 0.00000 | NA | 0.00 | 0.00 | 507.78 | 0.00 | 507.78 | 0.00% |

| 種類 | 投資ID | 数量 | 価格 (現地通貨) | 取得原価 (現地通貨) | 帳簿上の 取得原価 | 帳簿上の 未実現損益 | 経過利 息 | 帳簿上の 時価 | 投資 比率 |
|-----------------|------|------------------|--------------|----------------|---------------|---------------|----------|---------------|----------|
| 未払報告書作成費 用 | | | | | -5,404.41 | 0.00 | 0.00 | -5,404.41 | 0.03% |
| 現金および現金 等価物 | | | | | -5,404.41 | 0.00 | 0.00 | -5,404.41 | 0.03% |
| ユーロ | | | | | -5,404.41 | 0.00 | 0.00 | -5,404.41 | 0.03% |
| ユーロ | EUR | -4,803.88000 | 1.0000 | -4,803.88 | -5,404.41 | 0.00 | 0.00 | -5,404.41 | 0.03% |
| スポット為替取引 未払金 | | | | | -33,788.50 | 73.88 | 0.00 | -33,714.62 | 0.16% |
| 現金および現金 等価物 | | | | | -33,788.50 | 73.88 | 0.00 | -33,714.62 | 0.16% |
| 日本円 | | | | | -33,788.50 | 73.88 | 0.00 | -33,714.62 | 0.16% |
| 日本円 | JPY | -5,011,172.00000 | 1.0000 | -5,011,172.00 | -33,788.50 | 73.88 | 0.00 | -33,714.62 | 0.16% |
| 未払受託報酬 | | | | | -5,864.03 | 0.00 | 0.00 | -5,864.03 | 0.03% |
| 現金および現金 等価物 | | | | | -5,864.03 | 0.00 | 0.00 | -5,864.03 | 0.03% |
| 米ドル | | | | | -5,864.03 | 0.00 | 0.00 | -5,864.03 | 0.03% |
| 米ドル | USD | -5,864.03000 | 1.0000 | -5,864.03 | -5,864.03 | 0.00 | 0.00 | -5,864.03 | 0.03% |
| 報告額合計 | | | | | 21,791,187.16 | -1,464,840.08 | 0.00 | 20,326,347.08 | 100.00% |

4 【管理会社の概況】

(1) 【資本金の額】(2022年11月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約260億円)
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、または延期されなければならない。)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す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つ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效地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つた事柄、(d) 受託会社または管理会社の会計士、ブローカー

カーや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)信託証書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見た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(信託証書第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(信託証書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。)。

信託証書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)管理会社による行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害、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)受託会社が信託証書の規定により、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権されており、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、2022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 | 3,162,579,123.47米ドル |

(3)【その他】

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

5 【管理会社の経理の概況】

- a . 管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b . 管理会社の中間財務書類は、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 . 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、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2022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=138.87円）で換算されている。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】

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2022年6月30日現在

(単位:米ドル)

資産

| | | 米ドル | 千円 |
|-----|--|------------------|---------------|
| 010 | 現金、中央銀行における現金残高およびその他の要求払預金 | 7,307,751,556.09 | 1,014,827,459 |
| 020 | 手元現金 | | |
| 030 | 中央銀行における現金残高 | 5,003,476,980.83 | 694,832,848 |
| 040 | その他の要求払預金 | 2,304,274,575.26 | 319,994,610 |
| 050 | 売買目的で保有される金融資産 | 107,099,072.14 | 14,872,848 |
| 060 | デリバティブ | 107,099,072.14 | 14,872,848 |
| 070 | 持分証券 | | |
| 080 | 債務証券 | | |
| 090 | ローンおよび貸付金 | | |
| 096 | 強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産 | | |
| 097 | 持分証券 | | |
| 098 | 債務証券 | | |
| 099 | ローンおよび貸付金 | | |
| 100 | 損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産 | | |
| 120 | 債務証券 | | |
| 130 | ローンおよび貸付金 | | |
| 141 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産 | 2,591.61 | 360 |
| 142 | 持分証券 | 2,591.61 | 360 |
| 143 | 債務証券 | | |
| 144 | ローンおよび貸付金 | | |
| 181 | 償却後原価における金融資産 | 2,040,386,764.92 | 283,348,510 |
| 182 | 債務証券 | | |
| 183 | ローンおよび貸付金 | 2,040,386,764.92 | 283,348,510 |
| 240 | デリバティブ - ヘッジ会計 | | |
| 250 | 金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおける ヘッジ項目の公正価値変動 | | |
| 260 | 子会社、合弁会社および関連会社への投資 | | |
| 270 | 有形資産 | 2,494,125.49 | 346,359 |
| 280 | 有形固定資産 | 2,494,125.49 | 346,359 |
| 290 | 投資不動産 | | |
| 300 | 無形資産 | 2,577,775.88 | 357,976 |
| 310 | 営業権 | | |
| 320 | その他の無形資産 | 2,577,775.88 | 357,976 |
| 330 | 税金資産 | 13,799,588.21 | 1,916,349 |
| 340 | 現行税金資産 | 13,799,588.21 | 1,916,349 |
| 350 | 繰延税金資産 | | |
| 360 | その他の資産 | 41,012,071.07 | 5,695,346 |
| 370 | 売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ | | |
| 380 | 資産合計 | 9,515,123,545.39 | 1,321,365,207 |

ルクセンブルク三菱UFJインベスター・サービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2022年6月30日現在

(単位:米ドル)

負債

| | | 米ドル | 千円 |
|-----|---------------------------------------|------------------|---------------|
| 010 | 売買目的で保有される金融負債 | 58,421,702.88 | 8,113,022 |
| 020 | デリバティブ | 58,421,702.88 | 8,113,022 |
| 030 | ショート・ポジション | | |
| 040 | 預金 | | |
| 050 | 発行済み債務証券 | | |
| 060 | その他の金融負債 | | |
| 070 | 損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融負債 | | |
| 080 | 預金 | | |
| 090 | 発行済み債務証券 | | |
| 100 | その他の金融負債 | | |
| 110 | 償却後原価で測定される金融負債 | 8,885,414,337.89 | 1,233,917,489 |
| 120 | 預金 | 8,883,247,381.29 | 1,233,616,564 |
| 130 | 発行済み債務証券 | | |
| 140 | その他の金融負債 | 2,166,956.60 | 300,925 |
| 150 | デリバティブ - ヘッジ会計 | | |
| 160 | 金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおける ヘッジ項目の公正価値変動 | | |
| 170 | 引当金 | | |
| 180 | 年金およびその他の退職後給付金債務 | | |
| 190 | その他の長期従業員給付金 | | |
| 200 | 再編 | | |
| 210 | 係属中の法的問題および租税訟務 | | |
| 220 | コミットメントおよび保証 | | |
| 230 | その他の引当金 | | |
| 240 | 税金負債 | 15,689,662.84 | 2,178,823 |
| 250 | 現行税金負債 | 14,990,027.56 | 2,081,665 |
| 260 | 繰延税金負債 | 699,635.28 | 97,158 |
| 270 | 要求払株式資本 | | |
| 280 | その他の負債 | 36,068,672.82 | 5,008,857 |
| 290 | 売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債 | | |
| 300 | 負債合計 | 8,995,594,376.44 | 1,249,218,191 |

ルクセンブルク三菱UFJインベスター・サービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2022年6月30日現在

(単位:米ドル)

資本

米ドル

千円

| | | | |
|-----|---|----------------|------------|
| 010 | 資本 | 187,117,965.90 | 25,985,072 |
| 020 | 払込資本 | 187,117,965.90 | 25,985,072 |
| 030 | 未払込請求資本 | | |
| 040 | 株式発行差金 | | |
| 050 | 資本を除く発行済みエクイティ商品 | | |
| 060 | 複合金融商品のエクイティ部分 | | |
| 070 | その他の発行済みエクイティ商品 | | |
| 080 | その他のエクイティ | | |
| 090 | その他の累積包括利益 | | |
| 095 | 損益に再分類されることのない項目 | | |
| 100 | 有形資産 | | |
| 110 | 無形資産 | | |
| 120 | 確定給付型年金制度に係る数理計算上の利益または(-)損失 | | |
| 122 | 売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ | | |
| 124 | 子会社、合弁会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分 | | |
| 320 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動 | | |
| 330 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値ヘッジに対するヘッジ非有効性 | | |
| 340 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ項目〕 | | |
| 350 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ手段〕 | | |
| 360 | 信用リスク変動に帰属する損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債の公正価値変動 | | |
| 128 | 損益に再分類されることがある項目 | | |
| 130 | 外国事業純投資のヘッジ〔有効部分〕 | | |
| 140 | 外貨換算 | | |
| 150 | ヘッジ・デリバティブ、キャッシュ・フロー・ヘッジ準備金〔有効部分〕 | | |
| 155 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される債務証券の公正価値変動 | | |
| 165 | ヘッジ手段〔指定されていない要素〕 | | |
| 170 | 売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ | | |
| 180 | 子会社、合弁会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分 | | |
| 190 | 利益剰余金 | 794,885.79 | 110,386 |
| 200 | 再評価準備金 | | |
| 210 | その他の準備金 | 302,480,181.34 | 42,005,423 |
| 220 | 持分法を用いて計上される子会社、合弁会社および関連会社への投資の準備金または累積損失 | | |
| 230 | その他 | 302,480,181.34 | 42,005,423 |
| 240 | (-)自己株式 | | |
| 250 | 親会社株主に帰属する損益 | 29,136,135.93 | 4,046,135 |

| | | 米ドル | 千円 |
|-----|---------------|------------------|---------------|
| 260 | (-) 中間配当 | | |
| 270 | 少数株主持分(非支配持分) | | |
| 280 | その他の累積包括利益 | | |
| 290 | その他の項目 | | |
| 300 | 資本合計 | 519,529,168.96 | 72,147,016 |
| 310 | 資本および負債合計 | 9,515,123,545.40 | 1,321,365,207 |

(2) 【損益の状況】

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

損益計算書

2022年6月30日に終了した期間

(単位:米ドル)

| | | 米ドル | 千円 |
|-----|---|---------------|-----------|
| 010 | 利息収益 | 38,134,683.26 | 5,295,763 |
| 020 | 売買目的で保有される金融資産 | 29,158,916.27 | 4,049,299 |
| 025 | 強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産 | | |
| 030 | 損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産 | | |
| 041 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産 | | |
| 051 | 償却後原価における金融資産 | 5,162,052.74 | 716,854 |
| 070 | デリバティブ - ヘッジ会計、金利リスク | | |
| 080 | その他の資産 | 388,092.13 | 53,894 |
| 085 | 負債に係る利息収益 | 3,425,622.12 | 475,716 |
| 090 | (支払利息) | 19,073,028.47 | 2,648,671 |
| 100 | (売買目的で保有される金融負債) | 136,344.47 | 18,934 |
| 110 | (損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融負債) | | |
| 120 | (償却後原価で測定される金融負債) | 1,453,880.25 | 201,900 |
| 130 | (デリバティブ - ヘッジ会計、金利リスク) | | |
| 140 | (その他の負債) | 43,945.63 | 6,103 |
| 145 | (資産に係る支払利息) | 17,438,858.12 | 2,421,734 |
| 150 | (要求払株式資本に係る費用) | | |
| 160 | 受取配当 | | |
| 170 | 売買目的で保有される金融資産 | | |
| 175 | 強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産 | | |
| 191 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産 | | |
| 192 | 持分法を用いて計上されるもの以外の子会社、合弁会社および 関連会社への投資 | | |
| 200 | 受取手数料 | 69,068,200.25 | 9,591,501 |
| 210 | (支払手数料) | 25,936,416.67 | 3,601,790 |
| 220 | 損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負 債の認識除外に係る利益または(-)損失、純額 | | |
| 231 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産 | | |
| 241 | 償却後原価における金融資産 | | |
| 260 | 償却後原価で測定される金融負債 | | |
| 270 | その他 | | |
| 280 | 売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益または (-)損失、純額 | 8,728,801.26 | 1,212,169 |
| 287 | 強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される売買目的保 有以外の金融資産に係る利益または(-)損失、純額 | | |
| 290 | 損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして指定した 金融資産および負債に係る利益または(-)損失、純額 | | |
| 300 | ヘッジ会計からの利益または(-)損失、純額 | | |
| 310 | 為替差額〔利益または(-)損失〕、純額 | | |
| 320 | 子会社、合弁会社および関連会社への投資の認識除外に係る利 益または(-)損失、純額 | | |
| 330 | 非金融資産の認識除外に係る利益または(-)損失、純額 | | |
| 340 | その他の事業収益 | 3,652,536.23 | 507,228 |

米ドル 千円

| | | | |
|-----|---|---------------|------------|
| 350 | (その他の事業費用) | 1,470,368.69 | 204,190 |
| 355 | 事業収益合計、純額 | 73,104,407.17 | 10,152,009 |
| 360 | (管理費用) | 30,884,563.95 | 4,288,939 |
| 370 | (従業員費用) | 11,745,977.85 | 1,631,164 |
| 380 | (その他の管理費用) | 19,138,586.10 | 2,657,775 |
| 385 | (破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金) | 2,148,302.61 | 298,335 |
| 390 | (減価償却) | 1,340,688.86 | 186,181 |
| 400 | (有形固定資産) | 703,348.13 | 97,674 |
| 410 | (投資不動産) | | |
| 420 | (その他の無形資産) | 637,340.73 | 88,508 |
| 425 | 修正利益または(-)損失、純額 | | |
| 426 | その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産 | | |
| 427 | 償却後原価における金融資産 | | |
| 430 | (引当金または(-)引当金の戻入) | | |
| 435 | (破綻処理基金および預金保証制度に支払うコミットメント) | | |
| 440 | (コミットメントおよび保証) | | |
| 450 | (その他の引当金) | | |
| 460 | (損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損または(-)減損の戻入) | 467,321.09 | 64,897 |
| 481 | (その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産) | | |
| 491 | (償却後原価における金融資産) | 467,321.09 | 64,897 |
| 510 | (子会社、合弁会社および関連会社への投資の減損または(-)減損の戻入) | | |
| 520 | (非金融資産に係る減損または(-)減損の戻入) | | |
| 530 | (有形固定資産) | | |
| 540 | (投資不動産) | | |
| 550 | (営業権) | | |
| 560 | (その他の無形資産) | | |
| 570 | (その他) | | |
| 580 | 損益認識されるマイナスの営業権 | | |
| 590 | 持分法を用いて計上される子会社、合弁会社および関連会社への投資の利益または(-)損失の持分 | | |
| 600 | 非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される売却グループからの利益または(-)損失 | | |
| 610 | 継続事業からの税引前利益または(-)損失 | 38,263,530.66 | 5,313,657 |
| 620 | (継続事業からの損益に関する税金費用または(-)収入) | 9,127,394.73 | 1,267,521 |
| 630 | 継続事業からの税引後利益または(-)損失 | 29,136,135.93 | 4,046,135 |
| 640 | 非継続事業からの税引後利益または(-)損失 | | |
| 650 | 非継続事業からの税引前利益または(-)損失 | | |
| 660 | (非継続事業に関する税金費用または(-)収入) | | |
| 670 | 当期利益または(-)損失 | 29,136,135.93 | 4,046,135 |
| 680 | 少数株主持分〔非支配持分〕に帰属する金額 | | |
| 690 | 親会社株主に帰属する金額 | 29,136,135.93 | 4,046,135 |