

【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】 2025年1月31日
- 【発行者名】 フランクリン・アドバイザーズ・インク
(Franklin Advisers, Inc.)
- 【代表者の役職氏名】 最高財務責任者 リンジー・H・オオシタ
(Lindsey H. Oshita, Chief Financial Officer)
- 【本店の所在の場所】 アメリカ合衆国 94403 カリフォルニア州 サン・マテオ市
フランクリン・パークウェイ1番
(One Franklin Parkway, San Mateo, California 94403, U.S.A.)
- 【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健
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外国法共同事業
- 【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
弁護士 大西 信治
弁護士 金光 由以
- 【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外国法共同事業
- 【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】
ケイマン籍パトナム・ディバーシファイド・インカム・トラスト
Putnam Diversified Income Trust (Cayman)
- 【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】
クラスM受益証券：上限見込額は、100億米ドル(約1兆4,480億円)
(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、2024年
8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相場場の仲値(1米
ドル=144.80円)による。
- 【縦覧に供する場所】 該当事項なし

(注)ケイマン籍パトナム・ディバーシファイド・インカム・トラストの管理会社は、2024年10月31日付で「ザ・パトナム・アドバイザーズ・カンパニー・エルエルシー」から「フランクリン・アドバイザーズ・インク」に変更された。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2024年10月15日に提出した有価証券届出書（2024年10月31日付有価証券届出書の訂正届出書により訂正済）（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、その他情報の更新を反映するため、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。

下線の部分は訂正箇所を示します。ただし、全文修正（更新）の場合は下線を付しておりません。

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 (2) 投資資産 | 1 ファンドの 運用状況 | (1) 投資状況 | 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

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(2024年11月末日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) |
|----------------------|--------|-----------------------------|---------|
| 外国投資信託 | ケイマン諸島 | 206,649,462 | 100.47 |
| 現金・その他の資産 (負債控除後) | | - 976,363 | - 0.47 |
| 合計(純資産総額) | | 205,673,099 (約31,003百万円) | 100.00 |

(注1) 投資比率とは、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、別段の記載のない限り、便宜上、2024年11月29日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=150.74円)による。以下同じ。

(注3) 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、ファンド証券は米ドル建てのため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドル貨をもって行う。

(注4) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入または切り捨てて記載している。従って、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、本書の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ある。従って、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

(2024年11月末日現在)

| 順位 | 銘柄 | 国名 | 業種 | 口数 (口) | 取得原価(米ドル) | | 時価(米ドル) | | 投資 比率 (%) |
|----|---|------------|----|------------|-----------|-------------|---------|-------------|-----------------|
| | | | | | 単価 | 金額 | 単価 | 金額 | |
| 1 | バトナム・ディ パーシファイド・ インカム・トラスト(ケイマン)マ スター・ファンド | ケイマン 諸島 | - | 37,155,915 | 8.80 | 327,077,230 | 5.56 | 206,649,462 | 100.47 |

マスター・ファンドの投資有価証券の主要銘柄

(2024年11月末日現在)

| 順位 | 銘柄 |
|----|---------------------------------------|
| 1 | FNMA FN30 TBA UMBS 05.5000 12/01/2054 |
| 2 | FNMA FN30 TBA UMBS 06.5000 12/01/2054 |
| 3 | GNMA Gii30 TBA 04.5000 12/01/2054 |
| 4 | GNMA Gii30 TBA 05.5000 12/01/2054 |
| 5 | GNMA Gii30 TBA 05.0000 12/01/2054 |
| 6 | GNMA Gii30 TBA 04.0000 12/01/2054 |
| 7 | Stacr 2016-Dna1 B 14.8485 07/25/2028 |
| 8 | FNMA FN30 TBA UMBS 05.0000 12/01/2054 |
| 9 | CAS 2016-C02 1B 17.0985 09/25/2028 |
| 10 | FNMA FN30 TBA UMBS 02.5000 12/01/2054 |

(注) 2024年11月末日現在のマスター・ファンドの保有ポートフォリオの26.13%を表す。

() 投資不動産物件

該当事項なし(2024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(2024年11月末日現在)。

(2) 運用実績

純資産の推移

2024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次のとおりである。

| | 純資産総額 | | 一口当たり純資産価格 | |
|------------|---------|--------|------------------------|------------|
| | 千米ドル | 百万円 | 米ドル | 円 |
| 2023年12月末日 | 225,378 | 33,973 | クラスM 5.33 クラスJ 5.43 | 803 819 |
| 2024年1月末日 | 223,259 | 33,654 | クラスM 5.33 クラスJ 5.43 | 803 819 |
| 2月末日 | 219,958 | 33,156 | クラスM 5.32 クラスJ 5.42 | 802 817 |
| 3月末日 | 219,263 | 33,052 | クラスM 5.35 クラスJ 5.45 | 806 822 |
| 4月末日 | 210,985 | 31,804 | クラスM 5.23 クラスJ 5.34 | 788 805 |
| 5月末日 | 209,558 | 31,589 | クラスM 5.28 クラスJ 5.39 | 796 812 |
| 6月末日 | 209,769 | 31,621 | クラスM 5.32 クラスJ 5.43 | 802 819 |
| 7月末日 | 211,996 | 31,956 | クラスM 5.42 クラスJ 5.53 | 817 834 |
| 8月末日 | 210,412 | 31,718 | クラスM 5.47 クラスJ 5.58 | 825 841 |
| 9月末日 | 211,077 | 31,818 | クラスM 5.51 クラスJ 5.63 | 831 849 |
| 10月末日 | 205,028 | 30,906 | クラスM 5.40 クラスJ 5.52 | 814 832 |
| 11月末日 | 205,673 | 31,003 | クラスM 5.46 クラスJ 5.57 | 823 840 |

分配の推移

| | 一口当たり分配金 | |
|----------|------------|------|
| | 米ドル | 円 |
| 2023年12月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |
| 2024年1月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |
| 2月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |
| 3月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |
| 4月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |
| 5月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |
| 6月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |
| 7月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |
| 8月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |
| 9月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |
| 10月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |
| 11月 | クラスM 0.020 | 3.01 |
| | クラスJ 0.017 | 2.56 |

(注) 一口当たり分配金のデータは税引き前の数字である。

収益率の推移

| 直近 1 年間 | 収益率（注） | |
|--------------------------|--------|-------|
| | クラスM | クラスJ |
| 2023年12月 1 日～2024年11月30日 | 9.81% | 9.09% |

$$(\text{注}) \text{ 収益率} (\%) = 100 \times \left[\frac{\text{期末NAV} \times A}{\text{期首NAV}} - 1 \right]$$

A = 上記期間中の各月についての「一口当たり分配額 / 分配前NAV + 1」を計算して掛け合わせた数値

ただし、期末NAVとは2024年11月30日現在の一口当たり純資産価格をいい、期首NAVとは、2023年11月30日現在の一口当たり純資産価格をいう。

（参考情報）

純資産総額および一口当たり純資産価格の推移



(注1) 純資産総額は、クラスJ受益証券（後払手数料）を含むファンド全体の数字である。

(注2) 分配金再投資一口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものである。

(注3) ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではない。

[次へ](#)

2 販売及び買戻しの実績

2024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2024年11月末日現在の発行済口数は次のとおりである。

クラスM受益証券

| | 販売口数 | 買戻口数 | 発行済口数 |
|-------------|-----------|-------------|--------------|
| 2023年12月1日～ | 169,780 | 1,419,110 | 11,026,735 |
| 2024年11月30日 | (169,780) | (1,419,110) | (11,026,735) |

(注) 括弧内の数字は、本邦内における販売口数、買戻口数および発行済口数を表す。以下同じ。

クラスJ受益証券

| | 販売口数 | 買戻口数 | 発行済口数 |
|-------------|------|-------------|--------------|
| 2023年12月1日～ | 0 | 3,597,637 | 26,129,179 |
| 2024年11月30日 | (0) | (3,597,637) | (26,129,179) |

[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、ケイマン諸島における諸法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである(ただし、円換算部分を除く。)。これは、「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第328条第5項ただし書の規定の適用によるものである。
- 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円換算額が併記されている。日本円への換算には2024年11月29日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=150.74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

パトナム・ディバーシファイド・インカム・トラスト・ファンズ(ケイマン)

財政状態計算書(未監査)

(米ドル表示)

| | 2024年10月31日現在 | |
|--|---------------|------------|
| | 米ドル | 千円 |
| 資産 | | |
| 流動資産 | | |
| 損益を通じて公正価値で測定される金融資産 | 265,603,114 | 40,037,013 |
| 決済待ちの投資有価証券売却 | 45,558,424 | 6,867,477 |
| 先物契約に係る未収変動証拠金 | 23,304 | 3,513 |
| 未収利息およびその他の未収金 | 1,930,394 | 290,988 |
| 現金および現金等価物 | 9,646,421 | 1,454,102 |
| ブローカー預金 | 3,629,080 | 547,048 |
| 資産合計 | 326,390,737 | 49,200,140 |
| 負債 | | |
| 流動負債 | | |
| 損益を通じて公正価値で測定される金融負債 | 50,232,939 | 7,572,113 |
| 決済待ちの投資有価証券購入 | 67,174,736 | 10,125,920 |
| 決済待ちの受益証券買戻し | 158,730 | 23,927 |
| 中央清算機関で清算されるスワップ契約に係る未払変動証拠金 | 211,128 | 31,825 |
| 未払管理報酬 | 647,184 | 97,557 |
| 未払保管および管理事務代行報酬 | 82,682 | 12,463 |
| 特定のデリバティブ契約に係る担保、時価評価額 | 2,049,259 | 308,905 |
| ブローカーへの未払金 | 47,841 | 7,212 |
| その他の未払費用 | 615,397 | 92,765 |
| 負債合計(買戻可能受益証券の保有者に帰属する純資産を除く) | 121,219,896 | 18,272,687 |
| 公正価値で測定される買戻可能受益証券の保有者に帰属する純資産 | 205,170,841 | 30,927,453 |
| ケイマン籍パトナム・ディバーシファイド・インカム・トラストの買戻可能受益証券の保有者に帰属する純資産 | 205,027,983 | 30,905,918 |

パトナム・ディバーシファイド・インカム・トラスト・ファンズ（ケイマン）

包括損益計算書（未監査）

（米ドル表示）

| | 2024年10月31日に終了した6か月間 | |
|--|----------------------|-----------|
| | 米ドル | 千円 |
| 運用収益 | | |
| 損益を通じて公正価値で測定される金融資産および 金融負債からの利息 | 7,362,245 | 1,109,785 |
| 外貨建資産および負債に係る 実現および未実現純利益 / (損失) | 14,658 | 2,210 |
| 損益を通じて公正価値で測定される金融資産および 金融負債に係る実現および未実現純利益 / (損失) | 5,686,679 | 857,210 |
| 運用収益合計 | 13,063,582 | 1,969,204 |
| 運用費用 | | |
| 管理報酬 | 1,510,882 | 227,750 |
| 保管報酬 | 36,500 | 5,502 |
| 管理事務代行報酬 | 28,939 | 4,362 |
| 名義書換事務代行報酬 | 188,287 | 28,382 |
| 受託報酬 | 32,300 | 4,869 |
| 監査報酬 | 47,481 | 7,157 |
| その他の費用 | 38,566 | 5,813 |
| 管理会社からの払戻し | (159,908) | (24,105) |
| 運用費用合計 | 1,723,047 | 259,732 |
| 運用利益 | 11,340,535 | 1,709,472 |
| 財務費用 | | |
| 買戻可能受益証券の保有者に対する分配金 | (4,128,213) | (622,287) |
| 分配金控除後利益 | 7,212,322 | 1,087,185 |
| 運用による買戻可能受益証券の保有者に帰属する 純資産の増加 | 7,212,322 | 1,087,185 |

(2) 投資有価証券明細表等

ケイマン籍パトナム・ディバーシファイド・インカム・トラスト

統計表

2024年10月31日に終了した6か月間（未監査）

（米ドル表示）

ファンドの投資有価証券明細表

投資有価証券

| 取得原価（米ドル） | 資産名 | 時価（米ドル） |
|-------------|---|-------------|
| 181,003,732 | パトナム・ディバーシファイド・インカム・ トラスト（ケイマン）マスター・ファンド | 205,764,117 |

| 受益証券口数 | クラスJ | クラスM |
|---------------|-------------|------------|
| 期首残高 | 28,060,385 | 11,710,015 |
| 期中発行および払込受益証券 | - | 138,950 |
| 期中買戻受益証券 | (1,765,295) | (748,610) |
| 期末残高 | 26,295,090 | 11,100,355 |

純資産概要

| クラスJ | 一口当たり純資産価格（米ドル） | 純資産（米ドル） |
|-------------|-----------------|-------------|
| 2024年4月30日 | 5.34 | 149,729,709 |
| 2024年10月31日 | 5.52 | 145,043,457 |
| 変動割合 | 3.37 % | (3.13) % |

| クラスM | 一口当たり純資産価格（米ドル） | 純資産（米ドル） |
|-------------|-----------------|------------|
| 2024年4月30日 | 5.23 | 61,255,717 |
| 2024年10月31日 | 5.40 | 59,984,527 |
| 変動割合 | 3.25 % | (2.08) % |

[次へ](#)

4 管理会社の概況

(1) 資本金の額

管理会社の2024年9月末日現在の出資者持分合計は、78,008,919米ドル^(注)（未監査）（約118億円）である。

(注) 全額払込済み普通株式

(2) 事業の内容及び営業の状況

管理会社は、フランクリン・テンプルトンおよび/または子会社のブランド名で事業を行う子会社を有する持株会社であるフランクリン・リソーシズ・インクの完全子会社である。

2024年11月末日現在、管理会社は、以下の登録投資信託を管理している。

(2024年11月末日現在)

| 設立国または運用が行われている国 | 基本的性格 | 本数 | 純資産総額 (百万ドル) |
|------------------|----------------------------------|-----|-----------------|
| 米国 | クローズド・エンド型 ボンド・ファンド | 7 | 2,394.9 |
| | オープン・エンド型 ミックスド・アセット・ ファンド | 102 | 100,383.9 |
| | オープン・エンド型 ボンド・ファンド | 97 | 102,738.6 |
| | オープン・エンド型 エクイティ・ファンド | 39 | 109,370.7 |
| オーストラリア | オープン・エンド型 エクイティ・ファンド | 2 | 54.7 |
| バミューダ | オープン・エンド型 ボンド・ファンド | 1 | 67.5 |
| カナダ | オープン・エンド型 ミックスド・アセット・ ファンド | 1 | 266.1 |
| アイルランド | オープン・エンド型 ミックスド・アセット・ ファンド | 3 | 104.5 |
| | オープン・エンド型 ボンド・ファンド | 5 | 1,210.9 |
| 日本 | オープン・エンド型 ボンド・ファンド | 1 | 1.1 |
| | オープン・エンド型 エクイティ・ファンド | 1 | 525.6 |

| | | | |
|---------|----------------------------------|-----|-----------|
| ルクセンブルグ | オープン・エンド型 ミックスド・アセット・ ファンド | 7 | 9,119.8 |
| | オープン・エンド型 ボンド・ファンド | 15 | 11,669.1 |
| | オープン・エンド型 エクイティ・ファンド | 11 | 22,397.6 |
| イギリス | オープン・エンド型 ボンド・ファンド | 1 | 23.8 |
| | オープン・エンド型 エクイティ・ファンド | 1 | 99.1 |
| 合計 | | 294 | 360,428.1 |

(3) その他

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

[次へ](#)

(2) その他の訂正

第一部 証券情報

(8) 申込取扱場所

< 訂正前 >

(前略)

株式会社三井住友銀行

(中略)

電話番号：0120-56-3143（通話料有料）東京：03-5745-5051 大阪：06-6258-0012

平日・土・日・祝日 9：00～21：00 1月1日～3日と5月3日～5日を除く。

(注)上記各販売会社の日本における本支店において、申込みの取扱いを行う。

< 訂正後 >

(前略)

株式会社三井住友銀行

(中略)

電話番号：0120-431-952

(注)上記各販売会社の日本における本支店において、申込みの取扱いを行う。

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

< 訂正前 >

(前略)

管理会社の概況

(中略)

| | |
|----------|---|
| 3. 資本金の額 | 管理会社の2024年6月末日現在の払込資本の額は、78,008,919米ドル (注) (未監査) (約113億円)である。 (注) 全額払込済み普通株式。 |
|----------|---|

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

管理会社の概況

(中略)

| | |
|----------|---|
| 3. 資本金の額 | 管理会社の2024年9月末日現在の払込資本の額は、78,008,919米ドル (注) (未監査) (約118億円)である。 (注) 全額払込済み普通株式。 |
|----------|---|

(後略)

4 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

(前略)

日本

2024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）

日本

2024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）

第2 管理及び運営

5 受益者の権利等

（3）本邦における代理人

<訂正前>

森・濱田松本法律事務所 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

上記代理人は、管理会社から日本国内において、

- （ ）管理会社またはトラストおよびファンドに対する、法律上の問題および日本証券業協会の規則上の問題について一切の通信、請求、訴状、その他の訴訟関係書類を受領する権限、
- （ ）日本における受益証券の募集販売および買戻しの取引に関する一切の紛争、見解の相違に関する一切の裁判上、裁判外の行為を行う権限を委任されている。なお、関東財務局長に対する受益証券の募集、継続開示等に関する届出代理人および金融庁長官に対する届出代理人は、

弁護士 三 浦 健

弁護士 大 西 信 治

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

である。

<訂正後>

森・濱田松本法律事務所外国法共同事業 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

上記代理人は、管理会社から日本国内において、

- （ ）管理会社またはトラストおよびファンドに対する、法律上の問題および日本証券業協会の規則上の問題について一切の通信、請求、訴状、その他の訴訟関係書類を受領する権限、
- （ ）日本における受益証券の募集販売および買戻しの取引に関する一切の紛争、見解の相違に関する一切の裁判上、裁判外の行為を行う権限を委任されている。なお、関東財務局長に対する受益証券の募集、継続開示等に関する届出代理人および金融庁長官に対する届出代理人は、

弁護士 三 浦 健

弁護士 大 西 信 治

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外国法共同事業

である。