

【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】 平成27年12月22日
- 【発行者名】 B N Yメロン・インターナショナル・マネジメント・リミテッド
(BNY Mellon International Management Limited)
- 【代表者の役職氏名】 取締役 スコット・レノン
(Scott Lennon, Director)
- 【本店の所在の場所】 ケイマン諸島、KY1-9005、グランド・ケイマン、ジョージ・タウン、
エルジン・アベニュー190、
インタートラスト・コーポレート・サービスズ(ケイマン)リミテッド気
付
(c/o Intertrust Corporate Services (Cayman) Limited,
190 Elgin Avenue, George Town, Grand Cayman, KY1-9005,
Cayman Islands)
- 【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健
- 【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 三 浦 健
- 【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】
メロン・オフショア・ファンズ -
日興グローバル・カレンシー・ファンド
(Mellon Offshore Funds - Nikko Global Currency 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】
各クラス受益証券1億口について、それぞれの受益証券1口当たりの
各発行価格に各発行口数を乗じた金額の合計額を上限とする。
上限見込額は以下のとおりとする。
- | | |
|-------------|-----------------------|
| 米ドル建クラス受益証券 | 86.11億米ドル(約1兆681億円) |
| ユーロ建クラス受益証券 | 83.72億ユーロ(約1兆1,365億円) |
| 豪ドル建クラス受益証券 | 117.56億豪ドル(約1兆652億円) |
| 円建クラス受益証券 | 7,069億円 |
- (注1) 上限見込額は、便宜上、平成27年7月31日現在の1口当たり純資産価格(米ドル建クラス受益証券86.11米ドル、ユーロ建クラス受益証券83.72ユーロ、豪ドル建クラス受益証券117.56豪ドルおよび円建クラス受益証券7,069円)に募集する受益証券の口数(各1億口)をそれぞれ乗じて算出した金額である。
- (注2) 米ドル、ユーロおよび豪ドルの円貨換算は、別段の記載がない限り、便宜上、平成27年7月31日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=124.04円、1ユーロ=135.75円、1豪ドル=90.61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、2015年9月30日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により追加・訂正するため、また代行協会業務の変更、管理会社の取締役の変更等により、記載事項のうち訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するため、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) 半期報告書の提出に伴う訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

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	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
第1 ファンドの状況	(3) 運用実績		(2) 運用実績	更新/追加
5 運用状況	(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		3 ファンドの経理状況		追加
1 財務諸表				
第三部 特別情報			(2) 事業の内容及び営業の状況	更新
第1 管理会社の概況		4 管理会社の概況		
2 事業の内容及び営業の概況				
5 その他	(4) 訴訟事件その他の重要事項		(3) その他	追加

*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

メロン・オフショア・ファンズ（以下「トラスト」という。）のシリーズ・トラストである日興グローバル・カレンシー・ファンド（以下「ファンド」または「シリーズ・トラスト」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)

(2015年10月末日現在)

資産の種類	国名 (発行地)	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
政府短期債	米国	6,298,380.90	93.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		438,416.44	6.51
合計 (純資産価額)		6,736,797.34 (約814百万円)	100.00

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産価額に対する当該資産の時価の比率をいう。

(注2) 米ドル、ユーロおよび豪ドルの円貨換算は、別段の記載がない限り、便宜上、平成27年10月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=120.90円、1ユーロ=132.84円、1豪ドル=85.97円)による。

(注3) メロン・オフショア・ファンズ-日興グローバル・カレンシー・ファンドはケイマン諸島法に基づいて設定されているが、ファンド証券は、米ドル建クラス受益証券については米ドル建て、ユーロ建クラス受益証券についてはユーロ建て、豪ドル建クラス受益証券については豪ドル建て、円建クラス受益証券については円建てのため、以下の金額表示は別段の記載がない限り、米ドル、ユーロ、豪ドルまたは円とする。

(注4) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入されている。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。

(注5) 上記には「円建てファンド・オブ・ファンズ専用クラス」に帰属する投資資産が含まれる。

(2) 運用実績

純資産の推移

2015年10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。

() 米ドル建クラス受益証券

	純資産価額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2014年11月末日	1,311,395.03	158,548	87.40	10,567
12月末日	1,321,795.89	159,805	88.10	10,651
2015年1月末日	1,355,587.64	163,891	90.95	10,996
2月末日	1,263,744.44	152,787	91.07	11,010
3月末日	1,249,169.14	151,025	92.49	11,182
4月末日	1,210,730.19	146,377	89.64	10,837
5月末日	1,181,695.97	142,867	88.15	10,657
6月末日	1,124,501.59	135,952	86.13	10,413
7月末日	1,124,192.23	135,915	86.11	10,411
8月末日	1,114,986.51	134,802	85.40	10,325
9月末日	1,112,097.31	134,453	85.51	10,338
10月末日	1,106,658.52	133,795	85.42	10,327

() ユーロ建クラス受益証券

	純資産価額		1口当たり純資産価格	
	ユーロ	千円	ユーロ	円
2014年11月末日	3,520,621.25	467,679	84.85	11,271
12月末日	3,548,508.53	471,384	85.52	11,360
2015年1月末日	3,667,811.37	487,232	88.40	11,743
2月末日	3,671,664.66	487,744	88.49	11,755
3月末日	3,731,046.94	495,632	89.92	11,945
4月末日	3,617,724.88	480,579	87.19	11,582
5月末日	3,556,106.21	472,393	85.71	11,386
6月末日	3,475,793.09	461,724	83.77	11,128
7月末日	3,473,484.39	461,418	83.72	11,121
8月末日	3,445,086.50	457,645	83.03	11,030
9月末日	3,442,682.95	457,326	83.09	11,038
10月末日	3,438,682.33	456,795	83.00	11,026

() 豪ドル建クラス受益証券

	純資産価額		1口当たり純資産価格	
	豪ドル	千円	豪ドル	円
2014年11月末日	550,047.84	47,288	117.26	10,081
12月末日	555,787.84	47,781	118.48	10,186
2015年1月末日	575,396.82	49,467	122.66	10,545
2月末日	577,243.93	49,626	123.05	10,579
3月末日	587,513.98	50,509	125.24	10,767
4月末日	570,992.33	49,088	121.72	10,464
5月末日	562,333.68	48,344	119.88	10,306
6月末日	550,580.30	47,333	117.37	10,090
7月末日	525,630.01	45,188	117.56	10,107
8月末日	522,071.23	44,882	116.77	10,039
9月末日	523,570.74	45,011	117.10	10,067
10月末日	523,810.97	45,032	117.16	10,072

() 円建クラス受益証券

	純資産価額	1口当たり純資産価格
	千円	円
2014年11月末日	139,446	7,201
12月末日	135,409	7,254
2015年1月末日	139,595	7,484
2月末日	138,738	7,492
3月末日	135,489	7,606
4月末日	131,280	7,370
5月末日	128,206	7,245
6月末日	122,683	7,075
7月末日	120,571	7,069
8月末日	117,947	7,011
9月末日	118,016	7,015
10月末日	117,219	7,006

< 参考情報 >

純資産価額および1口当たり純資産価格の推移

(2003年11月25日(設定日)～2015年10月末日)

■ 純資産価額(右軸) — 1口当たり純資産価格(左軸)

米ドル建クラス



ユーロ建クラス



豪ドル建クラス



円建クラス



ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を保証または示唆するものではない。

分配の推移

該当事項なし。

収益率の推移

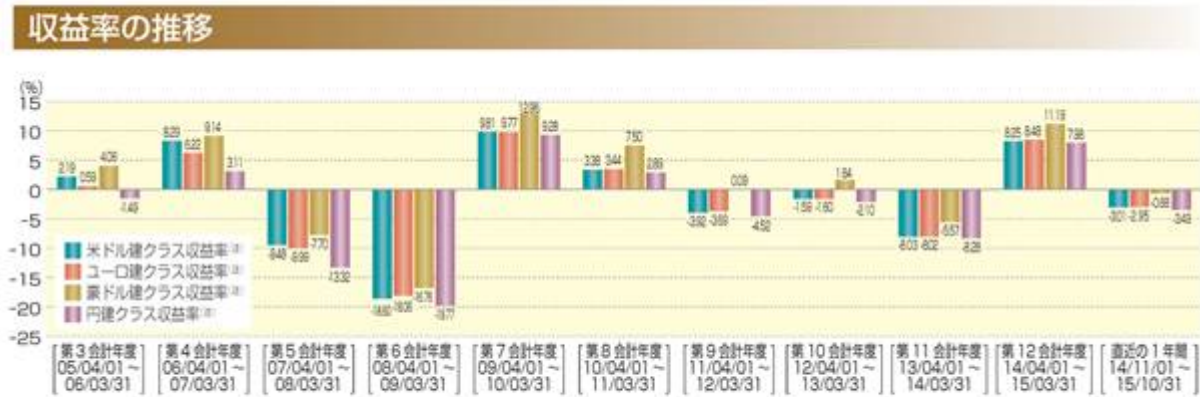
計算期間	収益率(注)			
	米ドル建 クラス 受益証券	ユーロ建 クラス 受益証券	豪ドル建 クラス 受益証券	円建 クラス 受益証券
2014年11月1日～2015年10月末日	-3.01%	-2.95%	-0.68%	-3.49%

(注) 収益率(%) = 100 × (a - b) / b

a : 2015年10月末日現在の1口当たり純資産価格(当該計算期間の分配金の合計額を加えた額)

b : 2014年10月末日現在の1口当たり純資産価格(分配落ちの額)

< 参考情報 >



(注)収益率(%)=100×(a-b)／b

a: 計算期末の1口当たり純資産価格(当該計算期間の分配金の合計額を加えた額)

b: 当該計算期間の直前の計算期末の1口当たり純資産価格(分配落ちの額)

ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を保証または示唆するものではない。

[次へ](#)

2 販売及び買戻しの実績

2015年10月末日までの1年間における受益証券の販売および買戻しの実績ならびに2015年10月末日現在の受益証券の発行済口数は、以下のとおりである。

() 米ドル建クラス受益証券

販売口数	買戻口数	発行済口数
0	2,275	12,956
(0)	(2,275)	(12,956)

(注) 上記数値は、申込ベースである。また、()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。以下同じ。

() ユーロ建クラス受益証券

販売口数	買戻口数	発行済口数
0	60	41,431
(0)	(60)	(41,431)

() 豪ドル建クラス受益証券

販売口数	買戻口数	発行済口数
0	390	4,471
(0)	(390)	(4,471)

() 円建クラス受益証券

販売口数	買戻口数	発行済口数
0	3,534	16,732
(0)	(3,534)	(16,732)

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

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。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項ただし書の規定に準拠して作成されている。

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。

ファンドの原文（英文）の財務書類は、米ドルで表示されている。なお、各受益証券の情報に関しては、下記の通貨で表示されている。

- 1) 米ドル建クラス受益証券 = 米ドル
- 2) ユーロ建クラス受益証券 = ユーロ
- 3) 豪ドル建クラス受益証券 = 豪ドル
- 4) 円建クラス受益証券 = 日本円
- 5) 円建ファンド・オブ・ファンズ専用クラス受益証券 = 日本円

日本文の財務書類には、主要な金額について円換算が併記されている。円換算による金額は、下記に掲げた各通貨の2015年10月30日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値を使用して換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

- 1 米ドル = 120.90円
- 1 ユーロ = 132.84円
- 1 豪ドル = 85.97円

(1) 資産及び負債の状況

メロン・オフショア・ファンズ -
日興グローバル・カレンシー・ファンド
純資産計算書
2015年9月30日現在
(米ドルで表示)

	注記	日興グローバル・カレンシー・ファンド	
		米ドル	千円
資産			
投資有価証券			
取得原価		6,299,706.00	761,634
時価評価額	2.2	6,300,094.50	761,681
現金預金		580,644.63	70,200
為替先渡契約にかかる未実現評価益	2.5,9	97,577.47	11,797
未収利息		10.10	1
資産合計		6,978,326.70	843,680
負債			
為替先渡契約にかかる未実現評価損	2.5,9	49,195.88	5,948
未払専門家費用		24,410.51	2,951
未払印刷および公告費		18,010.22	2,177
未払管理報酬	3	3,873.69	468
未払販売報酬	3	3,157.45	382
未払代行協会員報酬	7	525.74	64
未払管理事務代行報酬	4	340.63	41
未払保管報酬	5	227.07	27
未払受託会社報酬	6	123.39	15
その他未払費用		45,085.57	5,451
負債合計		144,950.15	17,524
純資産総額		6,833,376.55	826,155
純資産額			
米ドル建クラス受益証券		1,112,097.31米ドル	134,452,565円
ユーロ建クラス受益証券		3,442,682.95ユーロ	457,326,003円
豪ドル建クラス受益証券		523,570.74豪ドル	45,011,377円
円建クラス受益証券		118,015,578円	
円建ファンド・オブ・ファンズ 専用クラス受益証券		60,632,052円	
発行済受益証券口数			
米ドル建クラス受益証券		13,006 □	
ユーロ建クラス受益証券		41,431 □	
豪ドル建クラス受益証券		4,471 □	
円建クラス受益証券		16,824 □	
円建ファンド・オブ・ファンズ 専用クラス受益証券		78,776,542 □	
1口当たり純資産価格			
米ドル建クラス受益証券		85.51米ドル	10,338円
ユーロ建クラス受益証券		83.09ユーロ	11,038円
豪ドル建クラス受益証券		117.10豪ドル	10,067円
円建クラス受益証券		7,015円	
円建ファンド・オブ・ファンズ 専用クラス受益証券		0.7697円	

添付の注記は、本財務書類と不可分のものである。

メロン・オフショア・ファンズ -
 日興グローバル・カレンシー・ファンド
 運用計算書および純資産変動計算書
 2015年9月30日に終了した期間
 （米ドルで表示）

	注記	日興グローバル・カレンシー・ファンド	
		米ドル	千円
収益			
債券にかかる利息	2.6	791.00	96
銀行利息		29.22	4
収益合計		820.22	99
費用			
管理報酬	3	23,964.63	2,897
販売報酬	3	19,482.60	2,355
専門家費用		13,620.00	1,647
印刷および公告費		7,956.00	962
代行協会員報酬	7	3,244.10	392
管理事務代行報酬	4	2,111.90	255
保管報酬	5	1,407.26	170
保護預り費用		352.14	43
受託報酬	6	351.58	43
取引手数料		30.00	4
その他の費用		17,599.67	2,128
費用合計		90,119.88	10,895
投資純損失		(89,299.66)	(10,796)
以下にかかる実現純損益：			
外国為替		8,098.79	979
投資有価証券		35.39	4
為替先渡契約		(529,603.27)	(64,029)
当期実現純損失		(610,768.75)	(73,842)
以下にかかる未実現評価損益の純変動：			
為替先渡契約		184,602.45	22,318
投資有価証券		17.50	2
外国為替		0.18	0
運用による純資産の純減少		(426,148.62)	(51,521)
資本の変動			
受益証券買戻支払額		(223,891.09)	(27,068)
資本の変動、純額		(223,891.09)	(27,068)
期首現在純資産額		7,483,416.26	904,745
期末現在純資産額		6,833,376.55	826,155

添付の注記は、本財務書類と不可分のものである。

メロン・オフショア・ファンズ -
日興グローバル・カレンシー・ファンド
統計情報

日興グローバル・カレンシー・ファンド

	米ドル建クラス 受益証券		ユーロ建クラス 受益証券	
期末現在発行済受益証券口数				
2014年3月31日	15,944	口	41,516	口
2015年3月31日	13,506	口	41,491	口
発行口数	-	口	-	口
買戻口数	(500)	口	(60)	口
2015年9月30日	13,006	口	41,431	口
	<u>米ドル</u>	<u>千円</u>	<u>ユーロ</u>	<u>千円</u>
期末現在純資産額				
2014年3月31日	1,362,257.34	164,697	3,441,402.96	457,156
2015年3月31日	1,249,169.14	151,025	3,731,046.94	495,632
2015年9月30日	1,112,097.31	134,453	3,442,682.95	457,326
	<u>米ドル</u>	<u>円</u>	<u>ユーロ</u>	<u>円</u>
期末現在1口当たり純資産価格				
2014年3月31日	85.44	10,330	82.89	11,011
2015年3月31日	92.49	11,182	89.92	11,945
2015年9月30日	85.51	10,338	83.09	11,038

メロン・オフショア・ファンズ -
日興グローバル・カレンシー・ファンド
統計情報

日興グローバル・カレンシー・ファンド

	豪ドル建クラス 受益証券	円建クラス 受益証券	円建ファンド・ オブ・ファンズ専用 クラス受益証券
期末現在発行済受益証券口数			
2014年3月31日	5,981 □	21,820 □	104,362,342 □
2015年3月31日	4,691 □	17,814 □	93,904,937 □
発行口数	- □	- □	- □
買戻口数	(220)□	(990)□	(15,128,395)□
2015年9月30日	4,471 □	16,824 □	78,776,542 □
	豪ドル	千円	円
期末現在純資産額			
2014年3月31日	673,718.42	57,920	153,692,960
2015年3月31日	587,513.98	50,509	135,489,117
2015年9月30日	523,570.74	45,011	118,015,578
	豪ドル	円	円
期末現在1口当たり純資産価格			
2014年3月31日	112.64	9,684	7,044
2015年3月31日	125.24	10,767	7,606
2015年9月30日	117.10	10,067	7,015

メロン・オフショア・ファンズ

財務書類に対する注記

2015年9月30日現在

日興グローバル・カレンシー・ファンド

注記1．活動および目的

メロン・オフショア・ファンズ（以下「トラスト」という）は、受託会社と管理会社との間で締結された2003年10月14日付基本信託証書によって設定されたオープン・エンド型アンブレラ型ユニット・トラストである。

日興グローバル・カレンシー・ファンド（以下「シリーズ・トラスト」という。）は、トラストの別個のシリーズ・トラストであり、2003年10月14日、2014年9月2日および2015年7月31日にC I B Cバンク・アンド・トラスト・カンパニー（ケイマン）リミテッド（以下「受託会社」という。）とB N Yメロン・インターナショナル・マネジメント・リミテッド（以下「管理会社」という。）との間で締結された基本信託証書および補足信託証書に従い設定された。

本財務書類は、シリーズ・トラストを限定的に対象としている。

クラス受益証券

豪ドル建クラス受益証券、ユーロ建クラス受益証券、米ドル建クラス受益証券、円建クラス受益証券および円建ファンド・オブ・ファンズ専用クラス受益証券の発行が可能である。円建ファンド・オブ・ファンズ専用クラス受益証券は、日本の法律に基づき組成されたファンド・オブ・ファンズまたは管理会社の判断によるその他の適格投資家のみにより申込が可能である。管理会社はその裁量により、受益証券の1口当たり購入価格の3%を上限とする初期費用に当該費用に係る税金を適宜上乗せした金額を、販売会社のために、豪ドル建クラス受益証券、ユーロ建クラス受益証券、米ドル建クラス受益証券および円建クラス受益証券の各発行分に対して支払う場合がある。円建ファンド・オブ・ファンズ専用クラス受益証券には初期費用は課せられない。

投資目的および方針

シリーズ・トラストの投資目的は、積極的な通貨の運用並びに資産担保証券および短期金融市場商品への投資により、中期から長期の期間を通して絶対収益を追求することである。収益は、有価証券の収益と通貨オーバーレイ戦略により発生するリターンが組み合わせられることにより発生する。

注記2．重要な会計方針

2.1 財務書類の表示

当財務書類は、投資信託に適用されるルクセンブルグで一般に認められた会計原則に準拠して作成されている。

2.2 有価証券およびその他の資産への投資の評価

- (a) 下記 (b) が適用される集団的投資スキームの持分を除き、かつ下記 (c) の規定に従い、証券市場において値付けされ、上場、取引または取扱われている投資対象の価格に基づくすべての計算は、関係評価時点またはその直前における当該投資対象の主要な証券取引所もしくは証券市場の最終取引価格または（最終取引価格が利用可能でない場合は）直近の利用可能な取引売呼値および直近の利用可能な取引買呼値の中間値を参照して行われるものとする。
- (b) 下記 (c) および (e) の規定に従い、集団的投資スキームの各持分の価格は、関係評価時点またはその直前における当該集団的投資スキームの受益証券もしくは株式の直前に発表された1口当たり純資産価格（利用可能な場合）または（同価格が利用可能でない場合は）当該受益証券もしくは株式の直前に発表された取引買呼値とするが、それぞれの場合において、当該価格は管理事務代行会社または当該集団的投資スキームのために公定価格情報の決定および提供を任命された者により提供されるものとする。
- (c) 純資産価額、取引売呼値、取引買呼値または建値が、上記 (a) または (b) に規定されるとおりに利用できなかった場合、該当する投資対象の公正価格は、管理会社が決定する方法により随時決定されるものとする。
- (d) 上記 (b) が適用される集団的投資スキームの持分を除き、市場において上場または通常取引されていない投資対象の価格は、当該投資対象の取得における支出金額（各場合において、印紙代、手数料その他の取得費用の金額を含む。）に相当する当初金額となるものとするが、ただし、管理会社は、受託会社の承認を得た上で、当該投資対象の評価を行う資格を有すると受託会社が認める専門家をして再評価を行わしめることができ、かつ、受託会社の要請に基づきこれを行わしめるものとする。
- (e) 上記の規定にかかわらず、管理会社が関連状況に鑑みて投資対象の評価の調整またはその他の評価方法の使用が投資対象の公平な価値を反映するために必要となると判断した場合、管理会社は、受託会社の同意を得た上で、かかる調整を行い、かかる方法の使用を認めることができる。

2.3 外貨換算

米ドル以外の通貨で表示される資産および負債は、当期末における実勢為替レートで米ドルに換算される。外貨建取引は、取引日の実勢為替レートにより米ドルに換算される。

当期の損益を決定するにあたり、外国為替換算にかかる未実現および実現利益または損失は、運用計算書および純資産変動計算書において認識されている。

組入有価証券の時価評価額に起因する未実現為替差損益は、投資有価証券にかかる未実現評価損益の純変動に含まれる。その他の為替差損益は運用計算書および純資産変動計算書に直接計上される。

2.4 設立費用

設立費用は、完全に償却されている。

2.5 為替先渡契約

為替先渡契約は、満期までの残存期間に係る純資産計算書日現在の先物レートで評価される。

為替先渡契約から生じる損益は、運用計算書および純資産変動計算書において認識される。

2.6 受取利息

受取利息は、日次ベースで未収計上される。

注記3．管理報酬および販売報酬

管理会社は、豪ドル建クラス受益証券、ユーロ建クラス受益証券、米ドル建クラス受益証券および円建クラス受益証券に関する受領管理報酬から販売報酬および代行協会員報酬を、ならびにすべてのクラス受益証券に関する受領管理報酬から投資運用報酬を支払う。副投資運用報酬は投資運用報酬から支払われる。

日本における販売会社および管理会社は、シリーズ・トラストの資産から、豪ドル建クラス受益証券、ユーロ建クラス受益証券、米ドル建クラス受益証券および円建クラス受益証券に帰属する純資産価額に対して合計で年率1.3%の報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、各評価日に発生し、かつ計算され、毎月後払いで支払われる。

受益証券に帰属する上記報酬は、以下のとおり分割される。

各日本における販売会社

- ・各日本における販売会社名義で登録される受益証券に帰属する純資産価額の部分に対して5億米ドル相当額以下の部分については年率0.60%、および
- ・各日本における販売会社名義で登録される受益証券に帰属する純資産価額の部分に対して5億米ドル相当額を超過する部分については年率0.65%

管理会社

- ・各日本における販売会社名義で登録される受益証券に帰属する純資産価額の部分に対して5億米ドル相当額以下の部分については年率0.70%、および
- ・各日本における販売会社名義で登録される受益証券に帰属する純資産価額の部分に対して5億米ドル相当額を超過する部分については年率0.65%

管理会社はまた、シリーズ・トラストの資産から、円建ファンド・オブ・ファンズ専用クラス受益証券に帰属する純資産価額に対して年率0.45%の管理報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、各評価日に発生し、かつ計算され、毎月後払いで支払われる。

管理会社は、ファンドから受領する管理報酬から投資運用会社の報酬を支払うものとする。副投資運用会社、および投資運用会社によりシリーズ・トラストに関する当該職務を遂行するために任命されたその他委託者または関係者の報酬は、投資運用会社から支払われるものとする。

注記4．管理事務代行報酬

管理事務代行会社は、シリーズ・トラストの資産から、純資産価額に対して年率0.06%の報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、各評価日に発生し、かつ計算され、毎月後払いで支払われる。

注記5．保管報酬

保管会社は、シリーズ・トラストの資産から、純資産価額に対して年率0.04%の報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、各評価日に発生し、かつ計算され、毎月後払いで取引報酬および取引費用を上乗せした金額で支払われる。

注記6．受託報酬

受託会社は、シリーズ・トラストの資産から、純資産価額に対して年率0.01%の受託報酬(ただし最大年間報酬額は7,500米ドル)を受領する権利を有し、かかる報酬は、各評価日に発生し、計算され、暦四半期ごとに後払いで支払われる。

注記7．代行協会員報酬

代行協会員は、シリーズ・トラストの資産から、豪ドル建クラス受益証券、ユーロ建クラス受益証券、米ドル建クラス受益証券および円建クラス受益証券に帰属する純資産価額に対して年率0.10%の報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、各評価日に発生し、かつ計算され、毎月後払いで支払われる。

注記8．税金

ケイマン諸島

現行のケイマン諸島における税法に基づき、シリーズ・トラストにより支払われるその他の税金はない。従って、所得税に対する引当金は財務書類に計上されていない。

その他の国々

シリーズ・トラストは、その他の国々を源泉とする特定の収益に対し、源泉徴収税またはその他の税金を課される場合がある。

購入予定者は、各国の管轄法に基づき受益証券を購入、保有および買戻す際、予想される課税およびその他の影響を決定づけるその市民権、居住地および住居を所有する国において、法律アドバイザーまたは税務アドバイザーに相談することが望ましい。

注記9．為替先渡契約

2015年9月30日現在、以下の為替先渡契約が未決済であった。

9.1 シリーズ・トラストの通貨エクスポージャーの管理に関する為替先渡契約

通貨	売り	通貨	買い	満期日	未実現評価益 /（評価損）
					米ドル
米ドル	868,772.12	豪ドル	1,247,098.00	2015年12月16日	1,729.49
米ドル	776,039.25	豪ドル	1,105,918.00	2015年12月16日	(4,084.34)
米ドル	111,062.91	カナダ・ドル	147,200.00	2015年12月16日	(1,347.69)
米ドル	111,062.91	カナダ・ドル	147,200.00	2015年12月16日	(1,347.69)
米ドル	111,062.91	カナダ・ドル	147,200.00	2015年12月16日	(1,347.69)
米ドル	111,062.91	カナダ・ドル	147,200.00	2015年12月16日	(1,347.69)
米ドル	111,062.91	カナダ・ドル	147,200.00	2015年12月16日	(1,347.69)
米ドル	99,625.50	カナダ・ドル	132,000.00	2015年12月16日	(1,239.57)
米ドル	74,718.00	カナダ・ドル	99,000.00	2015年12月16日	(928.55)
米ドル	74,719.12	カナダ・ドル	99,000.00	2015年12月16日	(929.67)
米ドル	504,664.02	カナダ・ドル	674,000.00	2015年12月16日	(2,299.47)
米ドル	618,906.02	日本円	74,052,105.00	2015年12月16日	(1,215.23)
米ドル	605,461.45	日本円	72,731,057.00	2015年12月16日	1,210.08
米ドル	20,811.95	スウェーデン・ クローナ	174,400.00	2015年12月16日	87.54
米ドル	20,811.95	スウェーデン・ クローナ	174,400.00	2015年12月16日	87.54
米ドル	20,811.95	スウェーデン・ クローナ	174,400.00	2015年12月16日	87.54
米ドル	20,811.95	スウェーデン・ クローナ	174,400.00	2015年12月16日	87.54
米ドル	20,811.95	スウェーデン・ クローナ	174,400.00	2015年12月16日	87.54
米ドル	107,004.19	スウェーデン・ クローナ	894,000.00	2015年12月16日	129.68
米ドル	86,151.95	スイス・フラン	83,800.00	2015年12月16日	74.66
米ドル	86,151.95	スイス・フラン	83,800.00	2015年12月16日	74.66
米ドル	86,151.95	スイス・フラン	83,800.00	2015年12月16日	74.66
米ドル	86,151.95	スイス・フラン	83,800.00	2015年12月16日	74.66
米ドル	86,151.95	スイス・フラン	83,800.00	2015年12月16日	74.66
米ドル	116,398.61	スイス・フラン	112,880.00	2015年12月16日	(249.92)
米ドル	112,975.13	スイス・フラン	109,560.00	2015年12月16日	(242.58)
米ドル	112,975.13	スイス・フラン	109,560.00	2015年12月16日	(242.58)
米ドル	147,097.10	スイス・フラン	142,400.00	2015年12月16日	(573.59)
米ドル	110,322.83	スイス・フラン	106,800.00	2015年12月16日	(430.20)
米ドル	110,508.10	スイス・フラン	106,800.00	2015年12月16日	(615.47)
米ドル	210,134.05	スイス・フラン	203,000.00	2015年12月16日	(1,255.74)
米ドル	91,096.37	英ポンド	59,400.00	2015年12月16日	(1,148.86)
米ドル	91,096.37	英ポンド	59,400.00	2015年12月16日	(1,148.86)
米ドル	93,856.87	英ポンド	61,200.00	2015年12月16日	(1,183.68)
米ドル	120,891.42	英ポンド	78,000.00	2015年12月16日	(2,778.53)
米ドル	161,119.30	英ポンド	104,000.00	2015年12月16日	(3,635.44)

通貨	売り	通貨	買い	満期日	未実現評価益 /(評価損)
					米ドル
米ドル	120,839.47	英ポンド	78,000.00	2015年12月16日	(2,726.58)
豪ドル	115,000.00	米ドル	80,027.35	2015年12月16日	(245.15)
豪ドル	115,000.00	米ドル	80,027.35	2015年12月16日	(245.15)
豪ドル	115,000.00	米ドル	80,027.35	2015年12月16日	(245.15)
豪ドル	115,000.00	米ドル	80,027.35	2015年12月16日	(245.15)
豪ドル	115,000.00	米ドル	80,027.35	2015年12月16日	(245.15)
豪ドル	429,000.00	米ドル	298,905.75	2015年12月16日	(545.61)
カナダ・ドル	439,300.00	米ドル	332,314.63	2015年12月16日	4,883.26
カナダ・ドル	968,900.00	米ドル	732,915.78	2015年12月16日	10,748.10
日本円	5,707,000.00	米ドル	47,824.16	2015年12月16日	220.37
ニュージーランド・ドル	253,156.00	米ドル	159,373.09	2015年12月16日	(1,314.74)
ニュージーランド・ドル	90,100.00	米ドル	56,895.63	2015年12月16日	(294.29)
ニュージーランド・ドル	87,450.00	米ドル	55,222.23	2015年12月16日	(285.64)
ニュージーランド・ドル	87,450.00	米ドル	55,222.23	2015年12月16日	(285.64)
ノルウェー・クローネ	7,702,681.00	米ドル	933,596.06	2015年12月16日	22,264.63
ノルウェー・クローネ	272,000.00	米ドル	32,903.89	2015年12月16日	722.61
ノルウェー・クローネ	272,000.00	米ドル	32,903.89	2015年12月16日	722.61
ノルウェー・クローネ	272,000.00	米ドル	32,903.89	2015年12月16日	722.61
ノルウェー・クローネ	272,000.00	米ドル	32,903.89	2015年12月16日	722.61
ノルウェー・クローネ	272,000.00	米ドル	32,903.89	2015年12月16日	722.61
ノルウェー・クローネ	272,000.00	米ドル	32,903.89	2015年12月16日	722.61
ノルウェー・クローネ	2,143,000.00	米ドル	253,215.98	2015年12月16日	(329.93)
スウェーデン・クローナ	1,181,940.00	米ドル	140,921.88	2015年12月16日	(717.73)
スウェーデン・クローナ	1,135,591.00	米ドル	135,286.04	2015年12月16日	(799.26)
スイス・フラン	260,695.00	米ドル	266,908.63	2015年12月16日	(1,335.37)
スイス・フラン	200,952.00	米ドル	205,740.61	2015年12月16日	(1,030.40)
スイス・フラン	443,544.00	米ドル	456,955.65	2015年12月16日	567.85
英ポンド	1,201,385.00	米ドル	1,845,327.36	2015年12月16日	26,108.64
英ポンド	30,600.00	米ドル	46,952.79	2015年12月16日	616.20
英ポンド	30,600.00	米ドル	46,952.79	2015年12月16日	616.20
英ポンド	30,600.00	米ドル	46,952.79	2015年12月16日	616.20
英ポンド	30,600.00	米ドル	46,952.79	2015年12月16日	616.20
英ポンド	30,600.00	米ドル	46,952.79	2015年12月16日	616.20
ユーロ	118,958.00	米ドル	133,178.48	2015年12月16日	(573.77)
ユーロ	50,983.00	米ドル	57,097.65	2015年12月16日	(225.86)
ユーロ	101,200.00	米ドル	113,601.55	2015年12月16日	(184.22)
ユーロ	101,200.00	米ドル	113,601.55	2015年12月16日	(184.22)
ユーロ	101,200.00	米ドル	113,601.55	2015年12月16日	(184.22)
ユーロ	101,200.00	米ドル	113,601.55	2015年12月16日	(184.22)

通貨	売り	通貨	買い	満期日	未実現評価益 /（評価損）
					米ドル
ユーロ	101,200.00	米ドル	113,601.55	2015年12月16日	(184.22)
ユーロ	135,660.00	米ドル	153,247.23	2015年12月16日	715.83
ユーロ	131,670.00	米ドル	148,739.96	2015年12月16日	694.78
ユーロ	131,670.00	米ドル	148,739.96	2015年12月16日	694.78
ユーロ	191,600.00	米ドル	214,652.55	2015年12月16日	(775.85)
ユーロ	143,700.00	米ドル	161,224.22	2015年12月16日	(347.08)
ユーロ	143,700.00	米ドル	160,989.41	2015年12月16日	(581.89)

シリーズ・トラストの通貨エクスポージャーの管理に関する為替先渡契約
にかかる未実現純評価益合計 32,215.32

9.2 ユーロ建クラス受益証券の通貨エクスポージャーをカバーするための為替先渡契約

通貨	売り	通貨	買い	満期日	未実現評価益 /（評価損）
					米ドル
米ドル	1,887,600.00	ユーロ	1,683,640.43	2015年10月5日	3,179.23
米ドル	1,887,600.00	ユーロ	1,683,784.61	2015年10月5日	3,341.13
米ドル	54,000.00	ユーロ	48,099.15	2015年10月5日	16.81
米ドル	36,000.00	ユーロ	31,990.10	2015年10月5日	(74.14)
ユーロ	5,321.76	米ドル	6,000.00	2015年10月5日	23.49

ユーロ建クラス受益証券の通貨エクスポージャーをカバーするための為替先渡契約
にかかる未実現純評価益合計 6,486.52

9.3 豪ドル建クラス受益証券の通貨エクスポージャーをカバーするための為替先渡契約

通貨	売り	通貨	買い	満期日	未実現評価益 /（評価損）
					米ドル
米ドル	190,100.00	豪ドル	268,573.38	2015年10月6日	(1,932.28)
米ドル	190,100.00	豪ドル	268,607.92	2015年10月6日	(1,908.07)
豪ドル	18,295.12	米ドル	13,000.00	2015年10月6日	182.10
米ドル	3,000.00	豪ドル	4,272.98	2015年10月6日	(6.26)

豪ドル建クラス受益証券の通貨エクスポージャーをカバーするための為替先渡契約
にかかる未実現純評価損合計 (3,664.51)

9.4 円建クラス受益証券の通貨エクスポージャーをカバーするための為替先渡契約

通貨	売り	通貨	買い	満期日	未実現評価益 /（評価損）
					米ドル
米ドル	472,050.00	日本円	57,173,704.00	2015年10月5日	4,326.96
米ドル	472,050.00	日本円	57,172,949.00	2015年10月5日	4,320.67
米ドル	21,000.00	日本円	2,543,247.00	2015年10月5日	190.59
米ドル	9,000.00	日本円	1,078,876.00	2015年10月5日	(10.69)
円建クラス受益証券の通貨エクスポージャーをカバーするための為替先渡契約 にかかる未実現純評価益合計					8,827.53

9.5 円建ファンド・オブ・ファンズ専用クラス受益証券の通貨エクスポージャーをカバーするための為替先渡契約

通貨	売り	通貨	買い	満期日	未実現評価益 /（評価損）
					米ドル
米ドル	241,500.00	日本円	29,249,972.00	2015年10月5日	2,213.66
米ドル	241,500.00	日本円	29,249,586.00	2015年10月5日	2,210.45
米ドル	11,000.00	日本円	1,332,177.00	2015年10月5日	99.84
米ドル	6,000.00	日本円	719,239.00	2015年10月5日	(7.22)
円建ファンド・オブ・ファンズ専用クラス受益証券の通貨エクスポージャーを カバーするための為替先渡契約にかかる未実現純評価益合計					4,516.73

注記10．為替レート

2015年9月30日現在、使用された米ドルに対する為替レートは以下の通りである。

通貨	為替レート	通貨	為替レート
豪ドル	1.4268	日本円	120.0336
カナダ・ドル	1.3413	ノルウェー・クローネ	8.4417
スイス・フラン	0.9746	ニュージーランド・ドル	1.5668
ユーロ	0.8905	スウェーデン・クローナ	8.3602
英ポンド	0.6602		

(2) 投資有価証券明細表等

メロン・オフショア・ファンズ

投資有価証券明細表

2015年9月30日現在

日興グローバル・カレンシー・ファンド

額面	銘柄	通貨	取得原価	時価	比率*
公認の証券取引所への上場が認められている、または他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券					
債券			米ドル	米ドル	%
6,300,000	US T-BILL 0.00 10DEC15	米ドル	6,299,706.00	6,300,094.50	92.20
債券合計			6,299,706.00	6,300,094.50	92.20
公認の証券取引所への上場が認められている、または他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券合計					
投資有価証券合計			6,299,706.00	6,300,094.50	92.20

(*) 百分率で表示された純資産総額に対する時価比率

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

メロン・オフショア・ファンズ

投資有価証券分類表

日興グローバル・カレンシー・ファンド

投資有価証券の国別および業種別分類

国名	業種	比率(%) *
米国		
	行政および防衛；強制的社会保障	92.20
		92.20

(*) 百分率で表示された純資産総額に対する時価比率

[次へ](#)

4 管理会社の概況

(1) 資本金の額

2015年6月末日現在の資本金の額は、246,310円で、全額払込済である。管理会社の授権株式総数は、普通株式450,000株および償還可能優先株式450,000株で、発行済株式数は、普通株式1,000株および償還可能優先株式1,000株である。なお、管理会社の純資産の額は、2015年6月末日現在、約65億円である。

(2) 事業の内容及び営業の状況

管理会社の事業の目的は、あらゆる種類の金融、商取引およびトレーディング業務ならびに銀行および信託業務を遂行し、引受け、また、これらの目的のいずれかに関連して差支えなく行うことのできるようなその他の業務を営むことを含む。

2015年9月末日現在、管理会社は、下記の投資信託の管理および運用を行っている。

国別（設立国）	種類別	本数	純資産額の合計
ケイマン諸島籍	オープン・エンド型 契約型投資信託	25	482,418,907,249円

(3) その他

本書提出前6か月以内において、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

下線または傍線の部分は訂正箇所を示します。

第一部 証券情報

(12) その他

() 引受等の概要等

< 訂正前 >

(前略)

(3) 管理会社は、S M B C日興証券株式会社をファンドに関して代行協会員に指定している。

(注) 代行協会員とは、外国投資信託証券の発行者と契約を締結し、ファンド証券に関する目論見書を日本証券業協会に提出し、受益証券1口当たり純資産価格の公表を行い、また決算報告書その他の書類を日本証券業協会に提出する等の業務を行う協会員をいう。

< 訂正後 >

(前略)

(3) 管理会社は、S M B C日興証券株式会社をファンドに関して代行協会員に指定している。

(注) 代行協会員とは、外国投資信託証券の発行者と契約を締結し、受益証券1口当たり純資産価格の公表を行い、またファンド証券に関する目論見書、決算報告書その他の書類を販売会社へ送付する等の業務を行う協会員をいう。

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

管理会社とファンドの関係法人の名称、ファンドの運営上の役割および契約等の概要

< 訂正前 >

(前略)

名 称	ファンド運営上の 役割	契約等の概要
-----	----------------	--------

(中略)

S M B C日興証券株式会社	代行協会員	代行協会員は、管理会社との間で代行協会員契約（改訂済）を締結している。かかる代行協会員契約は、管理会社によって任命された代行協会員が、 <u>目論見書の配付、受益証券1口当たり純資産価格の公表、決算報告書その他の書類を日本証券業協会へ提出または送付する（代行協会員業務）旨を規定している。</u>
-----------------	-------	--

(後略)

<訂正後>

(前略)

名 称	ファンド運営上の 役割	契約等の概要
-----	----------------	--------

(中略)

S M B C日興証券株式会社	代行協会員	代行協会員は、管理会社との間で代行協会員契約（改訂済）を締結している。かかる代行協会員契約は、管理会社によって任命された代行協会員が、受益証券1口当たり純資産価格の公表、目論見書、決算報告書その他の書類を販売会社へ送付する（代行協会員業務）旨を規定している。
-----------------	-------	---

(後略)

2 投資方針

(1) 投資方針

<訂正前>

(前略)

通貨オーバーレイ戦略は、MSCIワールド・インデックス^(注)に含まれる各国の公式通貨の店頭為替先渡契約におけるショート・ポジションおよびロング・ポジションによる投資にも用いられる。ファンドの資産は、当該通貨オーバーレイ戦略に関する担保として用いられる。

(注) 日本、米国および英国など合計23か国を含む世界の先進主要国企業の株式で構成される株価指数である（2015年7月末日現在）。

レバレッジは、ファンドの投資目的および投資方針と合致した銀行借入れおよびデリバティブへの投資を通して利用される可能性がある。

ファンドの運用目標は、相場の1サイクルにつき、受益証券の各クラス毎に、関連するクラスの受益証券の表示通貨の3か月物LIBORによる収益の実績を超える収益を得ることである。

上記のとおり、ファンドの投資目的は、公社債への投資により中長期において絶対収益を追求することである。ファンドは、株式またはそのデリバティブ商品に投資しない。

(中略)



※円建クラス、米ドル建クラス、ユーロ建クラスのベンチマークは3か月LIBOR(London Inter Bank Offered Rate: ロンドンの銀行間預金出し手金利)です。円建クラスは3か月円LIBOR、米ドル建クラスは3か月米ドルLIBOR、ユーロ建クラスは3か月ユーロLIBOR。豪ドル建クラスはThe BofA Merrill Lynch Australian Dollar 3-Month LIBOR Constant Maturity I。総て2015年7月末時点。

(中略)

流動性の高い外国為替市場

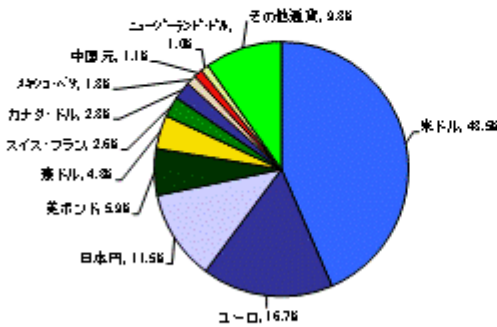
流動性の高い為替市場

外国為替市場の規模は1日平均で約5.3兆米ドル*1、約563兆円*2。
1日の取引額は日本のGDPの1.2倍に相当する非常に大きな市場です。
世界最大の市場はロンドン市場。1日平均2兆7260億米ドル*3で、
全体の約41%のシェアを占めています。

出所：国際通貨基金 World Economic Outlook April 2015
国際決済銀行 2013年9月、データは2013年4月時点

*1 ネット・ネットベース
*2 53,450兆米ドルを2015年7月時点の為替レート、米ドル124.04円で換算
*3 ネット・グロスベース

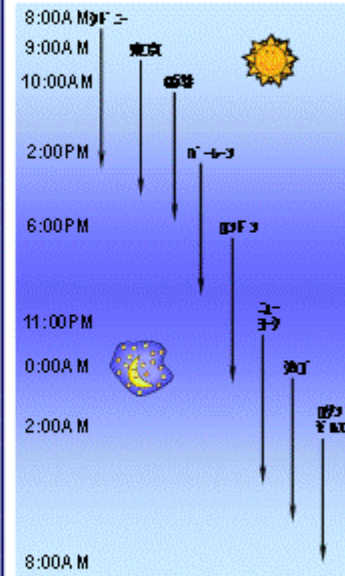
通貨別取引シェア



通貨別に取引シェアを見ると、主要10通貨の取引で、全体のシェアの約9割を占めていることが分かります。

出所：国際決済銀行 2013年9月、データは2013年4月時点

※比率の値は小数点以下第二位を四捨五入しており、端数処理の影響で足し合わせても100%にならないことがあります。

各国の外国為替市場
の取引開始時間（日本時間）

外国為替市場は24時間必ずどこかの国で
マーケットが開いています。

<訂正後>

（前略）

通貨オーバーレイ戦略は、MSCIワールド・インデックス^(注)に含まれる各国の公式通貨の店頭為替先渡契約におけるショート・ポジションおよびロング・ポジションによる投資にも用いられる。ファンドの資産は、当該通貨オーバーレイ戦略に関する担保として用いられる。

（注）日本、米国および英国など合計23か国を含む世界の先進主要国企業の株式で構成される株価指数である（2015年10月末日現在）。

レバレッジは、ファンドの投資目的および投資方針と合致した銀行借入れおよびデリバティブへの投資を通して利用される可能性がある。

ファンドの運用目標は、相場の1サイクルにつき、受益証券の各クラス毎に、関連するクラスの受益証券の表示通貨の3か月物LIBOR^(注)による収益の実績を超える収益を得ることである。

（注）LIBORの算出・公表が停止される場合には、LIBORと同等の指数となることがある。

上記のとおり、ファンドの投資目的は、公社債への投資により中長期において絶対収益を追求することである。ファンドは、株式またはそのデリバティブ商品に投資しない。

（中略）



※円建クラス、米ドル建クラス、ユーロ建クラスのベンチマークは3か月LIBOR(London Inter Bank Offered Rate: ロンドンの銀行間預金出し手金利)です。円建クラスは3か月円LIBOR、米ドル建クラスは3か月米ドルLIBOR、ユーロ建クラスは3か月ユーロLIBOR。豪ドル建クラスはThe BofA Merrill Lynch Australian Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index(2014年9月末日にThe BofA Merrill Lynch Australian Dollar 3-Month LIBOR Constant Maturity Index から名称変更されました。)。総て2015年10月末日時点。

（中略）

流動性の高い外国為替市場

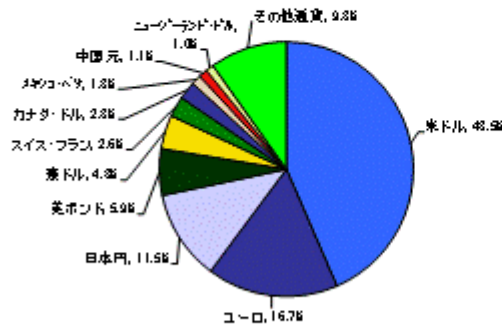
流動性の高い為替市場

外国為替市場の規模は1日平均で約5.3兆米ドル*1、約546兆円*2。
1日の取引額は日本のGDPの1.2倍に相当する非常に大きな市場です。
世界最大の市場はロンドン市場。1日平均2兆7260億米ドル*3で、
全体の約41%のシェアを占めています。

出所：国際通貨基金 World Economic Outlook, October 2015
国際決済銀行 2013年9月、データは2013年4月時点

*1 ネット・ネットベース
*2 53,450億米ドルを2015年10月末時点の為替レート、1米ドル=120.9円で換算
*3 ネット・グロスベース

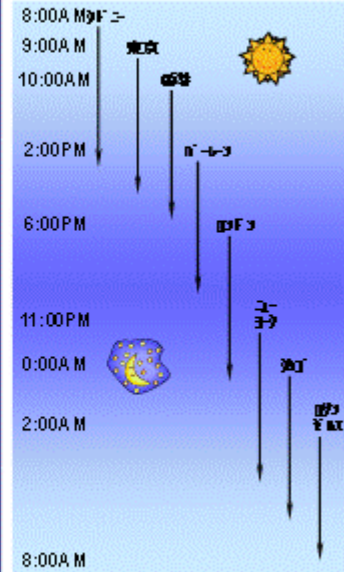
通貨別取引シェア



通貨別に取引シェアを見ると、主要10通貨の取引で、全体のシェアの約9割を占めていることが分かります。

出所：国際決済銀行 2013年9月、データは2013年4月時点

※比率の値は小数点以下第二位を四捨五入しており、端数処理の影響で足し合わせても100%にならないことがあります。

各国の外国為替市場
の取引開始時間（日本時間）

外国為替市場は24時間必ずどこかの国で
マーケットが開いています。

(3) 運用体制

< 訂正前 >

< 投資運用会社 >

(中略)

メロン・キャピタル・マネジメント・コーポレーションについて

- メロン・キャピタル・マネジメント・コーポレーションは、総合金融会社であるザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・コーポレーション傘下の資産運用会社の1つで、1983年に設立されました(本社サンフランシスコ)。同社は機関投資家を主な顧客とし、為替のオーバーレイ運用を含むタクティカル・アセット・アロケーションやインデックス運用に強みをもっております。
- 同社の運用資産残高は2015年6月末日時点で約3,917億米ドル(約49兆円)です。

(後略)

< 訂正後 >

< 投資運用会社 >

(中略)

メロン・キャピタル・マネジメント・コーポレーションについて

- メロン・キャピタル・マネジメント・コーポレーションは、総合金融会社であるザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・コーポレーション傘下の資産運用会社の1つで、1983年に設立されました(本社サンフランシスコ)。同社は機関投資家を主な顧客とし、為替のオーバーレイ運用を含むタクティカル・アセット・アロケーションやインデックス運用に強みをもっております。
- 同社の運用資産残高は2015年9月末日時点で約3,501億米ドル(約42兆円)です。

(注)米ドルの円貨換算は、便宜上、2015年10月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=120.90円)によります。

(後略)

4 手数料等及び税金

(3) 管理報酬等

(e) 代行協会員報酬

< 訂正前 >

代行協会員は、ファンドの資産から、受益証券に帰属する純資産価額に対して年率0.10%の報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、各評価日に計算され、同日付で計上され、毎月後払いされる。

代行協会員報酬は、目論見書、決算報告書等の日本証券業協会への提出業務、ファンド証券1口当たり純資産価格の公表業務、およびこれらに付随する業務の対価として代行協会員に支払われる。

< 訂正後 >

代行協会員は、ファンドの資産から、受益証券に帰属する純資産価額に対して年率0.10%の報酬を受領する権利を有する。かかる報酬は、各評価日に計算され、同日付で計上され、毎月後払いされる。

代行協会員報酬は、ファンド証券1口当たり純資産価格の公表業務、目論見書、決算報告書等の販売会社への送付業務、およびこれらに付随する業務の対価として代行協会員に支払われる。

(4) その他の手数料等

(b) 投資先ファンドの報酬および費用

<訂正前>

ファンドが別のファンドに投資を行う場合、投資先ファンド内では、管理報酬や実費等がかかることがある。実費については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができない。なお、2015年7月末日現在、組入れている投資先ファンドはないが、将来変更になる場合がある。

(後略)

<訂正後>

ファンドが別のファンドに投資を行う場合、投資先ファンド内では、管理報酬や実費等がかかることがある。実費については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができない。なお、2015年10月末日現在、組入れている投資先ファンドはないが、将来変更になる場合がある。

(後略)

(5) 課税上の取扱い

<訂正前>

(A) 日本

平成27年8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。

ファンドが税法上公募外国公社債投資信託である場合

(後略)

<訂正後>

(A) 日本

平成27年11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。

ファンドが税法上公募外国公社債投資信託である場合

(後略)

5 運用状況

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

以下の内容が追加されます。

< 参考情報 >

投資有価証券の主要銘柄

全銘柄

< 債券 >

(2015年10月末日現在)

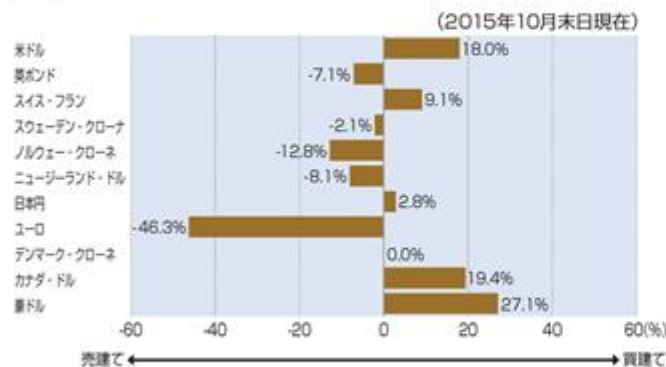
順位	銘柄名	投資比率(%)
1	US T-BILL 0.00 10MAR16	93.49

(注)投資比率とは、ファンドの純資産価額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資状況

ポートフォリオの特性

通貨配分



債券ポートフォリオ(米ドル建)の概況

(2015年10月末日現在)

平均格付け(注1)	AAA
実効デュレーション	0日
平均利回り	0.08%
セクター別構成比	
アセット・バック証券	0.00%
モーゲージ証券	0.00%
その他(現金等)(注2)	100.00%

※上記セクター別構成比の数値は、小数点第三位以下を四捨五入しており、合計値が100%にならないことがあります。
(注1)格付けはS&P、ムーディーズもしくはその他の認知された格付け業者のうち、いずれか高い格付けを採用し、S&P表記法で記載しています。

(注2)その他(現金等)には、現金に加え、米国国債(92.54%:2015年10月30日時点)が含まれております。

※当資料の運用実績に関するグラフおよび数値等は過去の実績であり、将来の運用成果を保証または示唆するものではありません。

第三部 特別情報

第1 管理会社の概況

1 管理会社の概況

(2) 会社の機構

<訂正前>

管理会社はケイマン諸島において設立され、現在存続している法人である。2015年7月末日現在、同社の取締役会は、以下の7名の取締役から構成される。

スティーブ・リピナー	取締役
スコット・レノン	取締役
ドニ・シャムサディン	取締役
ジェーン・ケー	取締役
ギ・ユーディン	取締役
パトリツィア・ブルツィオ	取締役
ブレンドン・ドネラン	取締役

権限を授けられた取締役がファンドに関して管理会社を代理する。

(後略)

<訂正後>

管理会社はケイマン諸島において設立され、現在存続している法人である。2015年11月末日現在、同社の取締役会は、以下の6名の取締役から構成される。

スコット・レノン	取締役
ドニ・シャムサディン	取締役
ジェーン・ケー	取締役
ギ・ユーディン	取締役
パトリツィア・ブルツィオ	取締役
ブレンドン・ドネラン	取締役

権限を授けられた取締役がファンドに関して管理会社を代理する。

(後略)