

**【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28年 4 月28日

**【発行者名】** HSBC マネジメント(ガーンジー)リミテッド  
(HSBC Management (Guernsey) Limited)

**【代表者の役職氏名】** ビジネス・マネジメント・ヘッド ケイト・チャールズ  
(Kate Charles)

**【本店の所在の場所】** チャネル諸島、GY1 3NF、ガーンジー、  
セント・ピーター・ポート、  
セント・ジュリアンズ・アベニュー、アーノルド・ハウス  
(Arnold House, St. Julian's Avenue, St. Peter Port,  
Guernsey GY1 3NF, Channel Islands)

**【代理人の氏名又は名称】** 弁護士 中 野 春 芽

**【代理人の住所又は所在地】** 東京都港区元赤坂一丁目 2 番 7 号  
赤坂Kタワー  
アンダーソン・毛利・友常法律事務所

**【事務連絡者氏名】** 弁護士 中 野 春 芽  
弁護士 三 宅 章 仁

**【連絡場所】** 東京都港区元赤坂一丁目 2 番 7 号  
赤坂Kタワー  
アンダーソン・毛利・友常法律事務所

**【電話番号】** 03(6888)1000

**【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】** HSBC ユニ・フォリオ  
(HSBC Uni-Folio)

【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】

HSBC トレーディング・アドバンテージ・ファンド  
米ドル・クラス受益証券について、5億アメリカ合衆国ドル(約614億1,000万円)を上限額とする。  
ユーロ・クラス受益証券について、5億ユーロ(約649億4,000万円)を上限額とする。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

(注) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)およびユーロの円換算額は、平成27年11月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客用電信売買相場の仲値(1米ドル=122.82円および1ユーロ=129.88円)による。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年4月28日に半期報告書を提出いたしましたので、平成28年1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。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、原届出書の記載事項のうち一部の事項に訂正の必要が生じた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原届出書の訂正

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 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 管理会社の概要	( ) 資本金の額	4 管理会社の概況	( 1 ) 資本金の額	更新
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	更新
	( 3 ) 運用実績		( 2 ) 運用実績	追加・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
5 その他			( 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

HSBC ユニ・フォリオ(HSBC Uni-Folio)(以下「ユニ・フォリオ」という。)のHSBC トレーディング・アドバンス・ファンド(以下「ファンド」という。)の運用状況は、以下の通りである。

## (1) 投資状況

## 資産別および地域別の投資状況

(平成28年2月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
投資信託	ケイマン諸島	39,885,823.70	62.22
	バミューダ	14,560,462.53	22.71
	英領ヴァージン諸島	10,421,286.04	16.26
	ルクセンブルグ	3,774,731.16	5.89
	小計	68,642,303.43	107.08
現金その他の資産(負債控除後)		- 4,539,418.60	- 7.08
合 計(純資産総額)		64,102,884.83 (約7,283百万円)	100.00

(注) 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。

## 投資資産

## ( イ ) 投資有価証券の主要銘柄

( 平成28年 2 月末日現在 )

順位	銘柄	国名	種類	保有株数 ( 株 )	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	AHL ( CAYMAN ) SPC - CLASS A1 EVOLUTION USD SHARES	ケイマン 諸島	投資 信託	7,207,809.00	1.02	7,384,643.00	1.5698	11314818.57	17.65
2	TEWKSBURY INVESTMENTS FUND LTD.	バミュー ダ	投資 信託	569.82	13897.42	7,918,985.47	19716.86162	11235002.94	17.53
3	TWO SIGMA COMPASS ENHANCED CAYMAN FUND LTD.	ケイマン 諸島	投資 信託	1,860.12	3835.72	7,134,906.59	5805.709405	10799327.79	16.85
4	WINTON FUTURES FUND LTD.	英領 ヴァージ ン諸島	投資 信託	9,710.62	691.96	6,719,406.71	1073.184636	10421286.04	16.26
5	TWO SIGMA INVESTMENT FUND LTD.	ケイマン 諸島	投資 信託	5,706.54	1000.00	5,706,542.00	1408.657024	8038560.47	12.54
6	CRABEL FUND SPC LTD.	ケイマン 諸島	投資 信託	5,520.51	1000.00	5,520,510.00	1059.124949	5846909.87	9.12
7	TRANSTREND FUND ALLIANCE - OMNITREND	ルクセン ブルグ	投資 信託	1,614.86	1988.85	3,211,714.56	2337.50181	3774731.16	5.89
8	LYNX ( BERMUDA ) LTD.	バミュー ダ	投資 信託	3,000.00	1000.00	3,000,000.00	938.8505667	2816551.7	4.39
9	CCP QUANTITATIVE FUND LTD.	ケイマン 諸島	投資 信託	1,280.97	1936.42	2,480,485.69	2140.759762	2742242.61	4.28
10	AHL EVOLUTION FRONTIER FUND	ケイマン 諸島	投資 信託	1,020,941.00	0.97	995,315.60	1.1205	1143964.39	1.78
11	LYNX BERMUDA LTD. - CLASS D	バミュー ダ	投資 信託	500.00	1000.00	500,000.00	1017.81578	508907.89	0.79

## ( ロ ) 投資不動産物件

平成28年 2 月末日現在、該当事項なし。

## ( ハ ) その他投資資産の主要なもの

平成28年 2 月末日現在、該当事項なし。

## ( 2 ) 運用実績

## 純資産の推移

平成28年2月末日までの一年間における各月末のファンドの純資産の推移は、次の通りである。

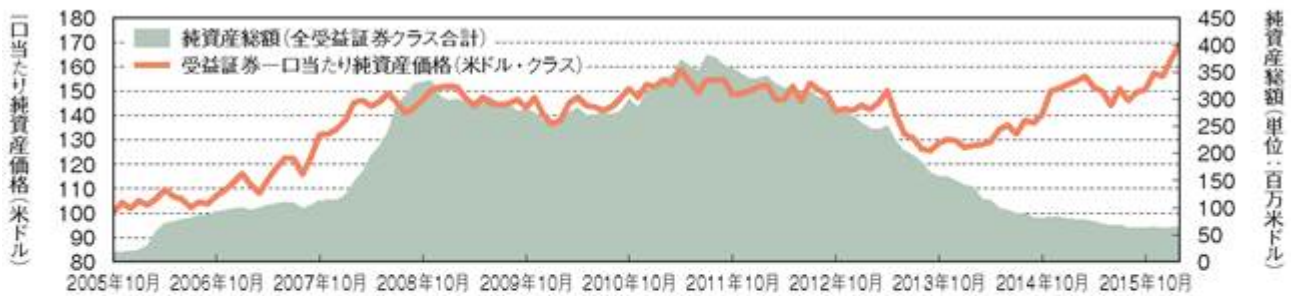
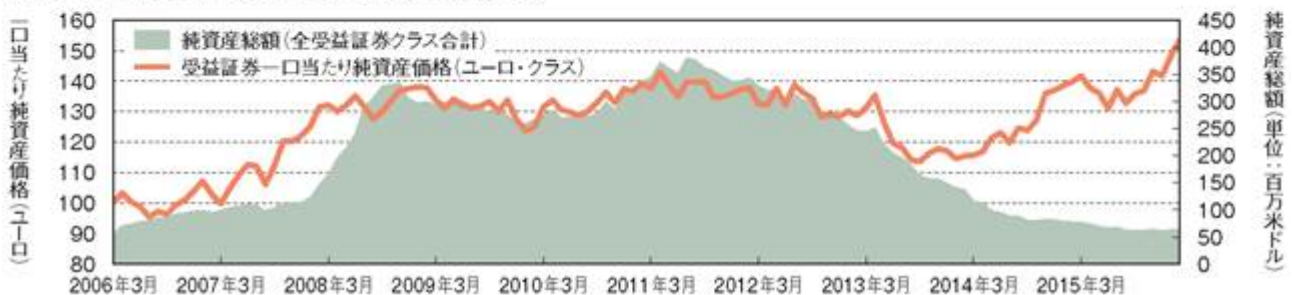
	純資産総額		一口当たり純資産価格		
	千米ドル	百万円	クラス	米ドル/ユーロ	円
平成27年3月末日	77,190	8,770	USD	156.14	17,741
			EUR	141.67	17,583
4月末日	74,015	8,410	USD	151.66	17,232
			EUR	137.74	17,095
5月末日	69,866	7,938	USD	149.87	17,028
			EUR	136.11	16,893
6月末日	66,647	7,572	USD	144.17	16,381
			EUR	131.03	16,262
7月末日	68,429	7,775	USD	151.04	17,161
			EUR	137.19	17,027
8月末日	62,537	7,105	USD	146.16	16,607
			EUR	132.74	16,474
9月末日	62,670	7,121	USD	149.60	16,998
			EUR	135.86	16,862
10月末日	62,753	7,130	USD	150.72	17,125
			EUR	136.87	16,987
11月末日	64,204	7,295	USD	157.40	17,884
			EUR	143.14	17,765
12月末日	62,001	7,045	USD	156.13	17,739
			EUR	141.78	17,596
平成28年1月末日	63,482	7,213	USD	163.21	18,544
			EUR	148.18	18,391
2月末日	64,103	7,283	USD	169.00	19,202
			EUR	153.35	19,032

(注1) 「クラス」欄の「USD」とは、米ドル・クラス受益証券、「EUR」とは、ユーロ・クラス受益証券のことをいう。

(注2) 上記の純資産総額は、千米ドル未満を四捨五入して記載されており、千米ドル未満を切り捨てて記載されている財務書類の数値とは異なる場合がある。

## &lt; 参考情報 &gt;

## ■純資産総額および受益証券一口当たり純資産価格の推移

HSBC トレーディング・アドバンテージ・ファンド(米ドル・クラス)  
(2005年10月31日から2016年2月29日まで)HSBC トレーディング・アドバンテージ・ファンド(ユーロ・クラス)  
(2006年3月31日から2016年2月29日まで)

## 分配の推移

該当事項なし。

## 収益率の推移

(米ドル・クラス)

	平成27年2月末日現在の一口 当たり純資産価格 (米ドル)	平成28年2月末日現在の一口 当たり純資産価格 (米ドル)	収益率(%)
平成27年3月1日～ 平成27年2月末日	154.27	169.00	9.55

(ユーロ・クラス)

	平成27年2月末日現在の一口 当たり純資産価格 (ユーロ)	平成28年2月末日現在の一口 当たり純資産価格 (ユーロ)	収益率(%)
平成27年3月1日～ 平成27年2月末日	139.88	153.35	9.63

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

a = 平成28年2月末日現在の一口当たり純資産価格(当該期間の分配金の合計額を加えた額)

b = 平成27年2月末日現在の一口当たり純資産価格(分配落の額)



## &lt; 参考情報 &gt;

## ■ 年間収益率の推移

## HSBC トレーディング・アドバンテージ・ファンド(米ドル・クラス)



(注1) 収益率(%)=100×(a-b)÷b

a=各暦年末の受益証券一口当たり純資産価格

ただし、2016年については、2016年2月末日の受益証券一口当たり純資産価格

b=当該各暦年の直前の暦年末の受益証券一口当たり純資産価格(分配額の額)

ただし、2005年については、当初申込期間の申込価格(100米ドル)

(注2) 2005年については、運用開始日(2005年10月31日)から2005年12月31日までの収益率。

2016年については、2016年1月1日から2016年2月末日までの収益率。

## HSBC トレーディング・アドバンテージ・ファンド(ユーロ・クラス)



(注1) 収益率(%)=100×(a-b)÷b

a=各暦年末の受益証券一口当たり純資産価格

ただし、2016年については、2016年2月末日の受益証券一口当たり純資産価格

b=当該各暦年の直前の暦年末の受益証券一口当たり純資産価格(分配額の額)

ただし、2006年については、当初申込期間の申込価格(100ユーロ)

(注2) 2006年については、運用開始日(2006年3月31日)から2006年12月31日までの収益率。

2016年については、2016年1月1日から2016年2月末日までの収益率。

## 2 販売及び買戻しの実績

平成28年2月末日前一年間におけるファンドの販売および買戻しの実績ならびに平成28年2月末日における発行済口数は、次の通りである。

## HSBCトレーディング・アドバンテージ・ファンド(米ドル・クラス)

販売口数	買戻口数	発行済口数
4,632.66 (3,336.23)	51,473.01 (9,252.95)	296,087.44 (47,293.05)

(注1) ( )の数字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。

(注2) 上記の販売口数、買戻口数および発行済口数には、平成28年2月29日付の取引口数は含まれていない。以下同じ。

## HSBCトレーディング・アドバンテージ・ファンド(ユーロ・クラス)

販売口数	買戻口数	発行済口数
0.00 (0.00)	1,185.69 (0.00)	4,456.50 (1,172.62)

[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、ガーンジーにおける諸法令および英国会計基準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「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 . 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、便宜上、平成28年2月29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 ( 1米ドル = 113.62円 ) が使用されている。なお、百万円未満の金額は四捨五入されている。
- d . ファンドの中間財務書類の原文と日本語に齟齬がある場合、原文が優先する。

[次へ](#)

## ( 1 ) 資産及び負債の状況

## H S B C トレーディング・アドバンテージ・ファンド

## 連結貸借対照表

2016年1月31日現在

( 未監査 )

	2016年1月31日		2015年7月31日	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円
資産				
組入投資有価証券	69,354	7,880	69,802	7,931
流動資産：				
債権	71	8	13	1
現金および預金残高	20	2	20	2
	<u>91</u>	<u>10</u>	<u>33</u>	<u>4</u>
資産合計	<u>69,445</u>	<u>7,890</u>	<u>69,835</u>	<u>7,935</u>
控除：				
債務：一年以内に期限の到来する金額	(5,963)	(678)	(1,406)	(160)
負債合計	<u>(5,963)</u>	<u>(678)</u>	<u>(1,406)</u>	<u>(160)</u>
買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純資産	<u>63,482</u>	<u>7,213</u>	<u>68,429</u>	<u>7,775</u>

	2016年1月31日	2015年7月31日	2015年1月31日	
発行済買戻可能参加受益証券口数 ( 口 )				
米ドル・クラス	299,643.97	311,515.53	348,959.96	
ユーロ・クラス	4,456.50	5,007.39	6,627.81	
スターリング・クラス	2,535.07	2,535.07	2,959.42	
ユーロ・ヘッジ・Rクラス	2,588.82	3,564.09	3,439.50	
米ドル・Rクラス	11,730.23	22,124.22	27,516.23	
スターリング・Rクラス	67,050.09	100,022.11	122,579.97	
一口当たり純資産価格				
米ドル・クラス	米ドル	163.21	151.04	152.75
ユーロ・クラス	ユーロ	148.18	137.19	138.56
スターリング・クラス	英ポンド	159.20	146.97	147.98
ユーロ・ヘッジ・Rクラス	ユーロ	116.00	106.89	107.39
米ドル・Rクラス	米ドル	118.40	109.08	109.68
スターリング・Rクラス	英ポンド	120.22	110.55	110.75
純資産総額				
米ドル・クラス	千米ドル	48,904	47,050	53,301
ユーロ・クラス	千ユーロ	660	687	918
スターリング・クラス	千英ポンド	404	373	438
ユーロ・ヘッジ・Rクラス	千ユーロ	300	381	369
米ドル・Rクラス	千米ドル	1,389	2,413	3,018
スターリング・Rクラス	千英ポンド	8,060	11,057	13,575

連結総収益計算書  
2016年1月31日に終了した6か月間  
( 未監査 )

	自2015年8月1日 至2016年1月31日		自2014年8月1日 至2015年1月31日	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円
純キャピタルゲイン	4,752	540	9,767	1,110
財務費用：支払利息	(23)	(3)	(39)	(4)
運用費用	(895)	(102)	(675)	(77)
純費用	(918)	(104)	(714)	(81)
買戻可能参加受益証券保有者に帰属する 投資活動による純資産の純増加	3,834	436	9,053	1,029

買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純資産の連結変動計算書  
2016年1月31日に終了した6か月間  
( 未監査 )

	自2015年8月1日 至2016年1月31日		自2014年8月1日 至2015年1月31日	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円
期首現在買戻可能参加受益証券保有者に 帰属する純資産	68,429	7,775	88,550	10,061
買戻可能参加受益証券発行および買戻し による変動：				
発行受領額 / 未収額	59	7	454	52
控除：買戻支払額 / 未払額	(8,840)	(1,004)	(19,158)	(2,177)
	(8,781)	(998)	(18,704)	(2,125)
買戻可能参加受益証券保有者に帰属する 投資活動による純資産の純増加	3,834	436	9,053	1,029
期末現在買戻可能参加受益証券保有者に 帰属する純資産	63,482	7,213	78,899	8,965

## ( 2 ) 投資有価証券明細表等

## H S B C トレーディング・アドバンテージ・ファンド

## 連結投資有価証券明細表

2016年1月31日現在

( 未監査 )

証券銘柄	保有高	時価 千米ドル	純資産総額 比率
ミューチュアル・ファンド			
米ドル (2015年7月31日: 102.01%)			
AHL (Cayman) SPC - Class A1 Evolution USD Shares	7,207,809	10,991	17.31%
AHL Evolution Frontier Fund	1,025,746	1,113	1.75%
CCP Quantitative Fund Ltd. - Aristarchus Class	1,281	2,600	4.10%
Crabel Fund SPC Ltd. - Segregated Portfolio - Series 95	5,521	5,648	8.90%
Discus Non US Side Holdings Ltd. - Class S	11,076	* -	0.00%
Lynx (Bermuda) Ltd.	3,000	2,720	4.28%
Lynx (Bermuda) Ltd. - Class D	500	491	0.77%
Tewksbury Investments Fund	609	11,725	18.48%
Transtrend Fund Alliance - Omnitrend	1,615	3,580	5.64%
Transtrend Fund Alliance - Omnitrend Plus (USD)	1	5	0.01%
Two Sigma Compass Enhanced Cayman Fund Ltd. GSY	1,860	10,164	16.01%
Two Sigma Investment Fund Ltd. - Class A	7,207	9,608	15.13%
Winton Futures Fund Ltd. - Class B	10,186	10,709	16.87%
組入投資有価証券		69,354	109.25%
純流動負債		(5,872)	(9.25%)
純資産総額		63,482	100.00%

\* 当該証券銘柄は、時価が500米ドルに満たないため、時価は提示されていない。

ポートフォリオの分類	ポートフォリオ における比率
未上場有価証券	100.00%
	100.00%

## 投資先別配分

2016年1月31日現在

マネージド・フューチャーズ	100.00%
合計	100.00%

重要なポートフォリオの変動の概要  
2016年1月31日に終了した6か月間

購入

	額面保有高	取得原価 千米ドル
購入合計	1,617	3,212

売却

	額面保有高	手取額 千米ドル
購入合計	5,447	9,459

\* 重要なポートフォリオの変動は、期首現在のファンドの純資産総額の1%を超える有価証券の購入額または売却額と定義されている。いかなる場合も、少なくとも購入および売却の上位20銘柄が表示されなければならない。

H S B C ユニ・フォリオは、1999年7月23日付信託証書に基づき設定され、現在1本のサブ・ファンド、H S B C トレーディング・アドバンテージ・ファンドにより構成される。信託証書の条項に基づき、管理会社および受託会社は、随時一または複数のサブ・ファンドを設定することができる。H S B C ユニ・フォリオの英文目論見書最新版の写しは、管理会社に請求することにより入手できる。さらに、H S B C ユニ・フォリオのサブ・ファンドに関する直近で入手可能な未監査連結中間財務書類および監査済連結年次財務書類全文の写しは、管理会社に請求することにより入手できる。

2015年7月31日終了年度の監査済報告書および財務書類全文の写しは、管理会社または受託会社に請求することにより無料で入手できる。

[次へ](#)

#### 4 管理会社の概況

##### ( 1 ) 資本金の額

資本金の額 平成28年2月末日現在、100,000英ポンド(約1,575万円)

(注)英ポンドの円貨換算額は、平成28年2月29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英ポンド=157.52円)による。

発行済株式総数 100,000株、

管理会社は、100,000株の授権株式資本のみ発行することができ、全株発行済みである。

##### ( 2 ) 事業の内容及び営業の状況

管理会社は、ファンドおよび受益者のために、証券の売買および申込みならびにファンド資産に直接または間接的に属する権利の行使を含む管理・運用業務を行う。

管理会社は、HSBC オルタナティブ・インベストメンツ・リミテッドに投資助言サービスの提供を委託している。また、管理会社は、管理事務代行会社であるステート・ストリート・ファンド・サービシーズ(アイルランド)リミテッドにファンドの管理事務代行業務を委託している。また、管理会社は、HSBC セキュリティーズ・サービシーズ(アイルランド)リミテッドにファンドの受益証券の発行、買戻しおよび名義書換等に関する事務代行業務を委託している。受託会社は、保管受託銀行であるステート・ストリート・カストディアル・サービシーズ(アイルランド)リミテッドにファンドの資産の受託保管を委託している。

管理会社は、平成28年2月末日現在、以下のとおり、6本の投資信託(合計純資産総額約4,460.0百万米ドル)の管理・運用を行っている。



ファンド名	国名	基本的性格	純資産総額 (百万米ドル) (平成28年2月末日 現在)
HSBC ポートフォリオ・セレクション・ ファンド (HSBC Portfolio Selection Fund)	ガーンジー	ガーンジー籍アンブレラ 型ユニット・トラスト	2,175.000
HSBC ユニ・フォリオ (HSBC Uni - Folio)	ガーンジー	ガーンジー籍アンブレラ 型ユニット・トラスト	64.103
HSBC オルタナティブ・ストラテジー・ ファンド (HSBC Alternative Strategy Fund)	ガーンジー	ガーンジー籍アンブレラ 型ユニット・トラスト	88.856
HSBC UCITS アドバンテージ・ファンド (HSBC UCITS AdvantEdge Fund)	アイルランド	UCITS型投資信託	226.188
BFC バリュース・チェーン・ファンド (BFC Value Chain Fund)	ガーンジー	ガーンジー籍アンブレラ 型ユニット・トラスト	16.029
プライベート・エクイティ・ファンド (Private equity funds)	ガーンジー	ガーンジー籍ユニット・ トラストおよびリミテッ ド・パートナーシップ	1,889.82

## (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、ユニ・フォリオおよびファンド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

( 注 ) 下線の部分は訂正部分を示します。

## 第三部 特別情報

## 第 1 管理会社の概況

## 3 管理会社の経理状況

< 訂正前 >

( 前略 )

- c. 管理会社の原文の財務書類は、米ドルで表示されている。日本文の財務書類には、主要な金額について円換算額が併記されている。日本円による金額は、便宜上、平成27年11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 ( 1 米ドル = 122.82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。

( 中略 )

中間財務書類

( 中略 )

- 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換算額が併記されている。日本円への換算には、便宜上、平成27年11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 ( 1 米ドル = 122.82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。

( 後略 )

< 訂正後 >

( 前略 )

- c. 管理会社の原文の財務書類は、米ドルで表示されている。日本文の財務書類には、主要な金額について円換算額が併記されている。日本円による金額は、便宜上、平成27年11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 ( 1 米ドル = 122.82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。

- d. 管理会社の財務書類の原文と日本文に齟齬がある場合、原文が優先する。

( 中略 )

中間財務書類

( 中略 )

- 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換算額が併記されている。日本円への換算には、便宜上、平成27年11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 ( 1 米ドル = 122.82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。

- d. 管理会社の中間財務書類の原文と日本文に齟齬がある場合、原文が優先する。

( 後略 )

## 別紙 A

&lt; 訂正前 &gt;

( 前略 )

## 9 投資先ファンド

平成27年10月末日現在、純資産総額の10%を超えて投資する投資先ファンドは以下の通りである。

投資先ファンドの名称	Tewksbury Investment Fund Ltd.
運用の基本方針	Tewksbury Investment Fund Ltd.は、広くかつ実質的に制限なく各種の金融商品の取引および投資を行い、広範な種々の市場環境および景気循環を通じ、優れたリスク調整済リターンを獲得することを目的とする。
投資対象	ポートフォリオ・マネジャーは、定量分析に加えてファンダメンタルズなりサーチに基づき、広い範囲の有価証券、デリバティブおよびその他の資産のロングおよびショートのパジションを構築し、独自の投資戦略を実行する。投資対象、取引することのできる市場もしくは戦略またはそれらを実行するために利用される仕組みおよび投資ビークルに、実質的な制限は課されていない。
投資運用会社	Stevens Capital Management LP

投資先ファンドの名称	Winton Futures Fund Ltd.
運用の基本方針	Winton Futures Fund Ltd.は、複合的な成長を通じた長期的な元本成長の達成を目指し、一定の投資制限のもと、分散投資戦略を追求する。
投資対象	Winton Futures Fund Ltd.は、現在、100超の先物市場、1000超の株式、通貨先物取引および株式CFD取引等の関連取引に分散投資している。さらに、Winton Futures Fund Ltd.はキャッシュ・マネジメントの目的で、他の金融商品にも投資する。これらの商品は、主に、短期米国債で構成されることが見込まれるが、政府、企業または他の団体の債券を含むことがある。
投資顧問会社	Winton Capital Management Limited

投資先ファンドの名称	AHL (Cayman) SPC - Class A1 Evolution USD Shares
運用の基本方針	AHL (Cayman) SPCの投資目的は、中期的なキャピタル・ゲインを達成することである。 AHL (Cayman) SPCは、各クラス受益証券の発行により調達される資金をAHL (投資運用会社の投資部門) が実施および運用する単一の戦略または複数の補完的な戦略に対して直接的または間接的に配分することによって、各クラス受益証券に関する自己の投資目的を達成することを追求する。
投資対象	Class A1 Evolution USD Sharesの発行から得られる収益は、様々な商品および株式または債務証券 (投資運用会社またはその関連会社が運用し、AHLエボリューション・プログラムの一部を構成する、規制されているかもしくは規制されていない集団的投資スキームまたはその他のプールされた (一もしくは複数の) ビークルを含むが、これらに限定されない。 ) への投資を通じて、世界中の市場における非効率性を特定する洗練され、かつ、コンピュータ化されたプロセスを採用して運用されるAHLエボリューション・プログラムに充当される。 AHLエボリューション・プログラムは、先物、オプション、先渡契約、スワップ、現物債券、現物株およびその他の取引所内外の金融デリバティブを含み、多様な商品ポートフォリオに分散投資する。当該市場は、直接的または間接的にアクセスすることができ、株式、債券、通貨、クレジットおよびコモディティを含むが、これらに限定されない。
投資運用会社	Man Investments Limitedの投資部門であるAHL

投資先ファンドの名称	Two Sigma Absolute Return Marco Enhanced
運用の基本方針	Two Sigma Absolute Return Macro Enhanced Cayman Fund, Ltd.の投資目的は、主として、投資運用会社により運用され、複数のモデル主導型投資戦略と投資運用会社独自のリスク・マネジメント手法および執行手法の活用を組み合わせた一または複数の取引主体への投資を通じて、米ドル建の絶対リターンを達成することである。
投資対象	流動性のある金融商品 (先物、先物オプション、現物取引、先渡、ETF (株式指数またはセクター指数に係るものを含む。 )、外国為替取引、債券、通貨契約、国債、ワラント、オプション (上場オプションおよび店頭オプションのいずれも )、レポ取引、逆レポ取引、スワップ (株式スワップ、商品スワップ、金利スワップ、通貨スワップ、先物類似スワップ、クレジット・デフォルト・スワップを含むすべての種類 )、外国為替取引に係るオプション、商品、米国および非米国マネー・マーケット・ファンドおよび短期金融商品 (財務省その他の政府機関債、地方債、社債、定期預金、約束手形およびユーロ・ドル・デポジットを含む。 )、通貨に係るノンデリバブル・フォワードならびに既存のまたは将来設定されるデリバティブまたは金融商品をいう。 )
投資運用会社	Two Sigma Advisers, LLC

投資先ファンドの名称	Two Sigma Compass Enhanced Cayman Fund Ltd
運用の基本方針	Two Sigma Compass Enhanced Cayman Fund Ltdの投資目的は、独自のリスク・マネジメント手法および執行手法と組み合わせられる複数の体系的なレバレッジ投資戦略の枠内で、主として世界中の先物取引および外国為替取引（直物および先渡）を活用することにより、米ドル建の絶対リターンを達成することである。
投資対象	統計に基づく（先物および外国通貨の）取引戦略およびこれに関連する条件付戦略、ファンダメンタル主導型の取引戦略、資金拠出者および市場心理に基づく取引戦略（Two Sigma PICSTM Programを含む。）、スプレッドに基づく取引戦略、ボラティリティ取引戦略ならびに混合型取引戦略。
投資運用会社	Two Sigma Investments, LLC

< 訂正後 >

（前略）

## 9 投資先ファンド

平成28年2月末日現在、純資産総額の10%を超えて投資する投資先ファンドは以下の通りである。

投資先ファンドの名称	AHL (Cayman) SPC - Class A1 Evolution USD Shares
運用の基本方針	AHL (Cayman) SPCの投資目的は、中期的なキャピタル・ゲインを達成することである。 AHL (Cayman) SPCは、各クラス受益証券の発行により調達される資金をAHL（投資運用会社の投資部門）が実施および運用する単一の戦略または複数の補完的な戦略に対して直接的または間接的に配分することによって、各クラス受益証券に関する自己の投資目的を達成することを追求する。
投資対象	Class A1 Evolution USD Sharesの発行から得られる収益は、様々な商品および株式または債務証券（投資運用会社またはその関連会社が運用し、AHLエボリューション・プログラムの一部を構成する、規制されているかもしくは規制されていない集団的投資スキームまたはその他のプールされた（一もしくは複数の）ビークルを含むが、これらに限定されない。）への投資を通じて、世界中の市場における非効率性を特定する洗練され、かつ、コンピュータ化されたプロセスを採用して運用されるAHLエボリューション・プログラムに充当される。 AHLエボリューション・プログラムは、先物、オプション、先渡契約、スワップ、現物債券、現物株およびその他の取引所内外の金融デリバティブを含み、多様な商品ポートフォリオに分散投資する。当該市場は、直接的または間接的にアクセスすることができ、株式、債券、通貨、クレジットおよびコモディティを含むが、これらに限定されない。
投資運用会社	Man Investments Limitedの投資部門であるAHL

投資先ファンドの名称	Tewksbury Investments Fund Ltd.
運用の基本方針	Tewksbury Investment Fund Ltd.は、広くかつ実質的に制限なく各種の金融商品の取引および投資を行い、広範な種々の市場環境および景気循環を通じ、優れたリスク調整済リターンを獲得することを目的とする。
投資対象	ポートフォリオ・マネジャーは、定量分析に加えてファンダメンタルズなリサーチに基づき、広い範囲の有価証券、デリバティブおよびその他の資産のロングおよびショートのポジションを構築し、独自の投資戦略を実行する。投資対象、取引することのできる市場もしくは戦略またはそれらを実行するために利用される仕組みおよび投資ビークルに、実質的な制限は課されていない。
投資運用会社	Stevens Capital Management LP

投資先ファンドの名称	Two Sigma Compass Enhanced Cayman Fund Ltd.
運用の基本方針	Two Sigma Compass Enhanced Cayman Fund Ltdの投資目的は、独自のリスク・マネジメント手法および執行手法と組み合わせられる複数の体系的なレバレッジ投資戦略の枠内で、主として世界中の先物取引および外国為替取引（直物および先渡）を活用することにより、米ドル建の絶対リターンを達成することである。
投資対象	統計に基づく（先物および外国通貨の）取引戦略およびこれに関連する条件付戦略、ファンダメンタル主導型の取引戦略、資金拠出者および市場心理に基づく取引戦略（Two Sigma PICSTM Programを含む。）、スプレッドに基づく取引戦略、ボラティリティ取引戦略ならびに混合型取引戦略。
投資運用会社	Two Sigma Investments, LLC

投資先ファンドの名称	Winton Futures Fund Ltd.
運用の基本方針	Winton Futures Fund Ltd.は、複合的な成長を通じた長期的な元本成長の達成を目指し、一定の投資制限のもと、分散投資戦略を追求する。
投資対象	Winton Futures Fund Ltd.は、現在、100超の先物市場、1000超の株式、通貨先物取引および株式CFD取引等の関連取引に分散投資している。さらに、Winton Futures Fund Ltd.はキャッシュ・マネジメントの目的で、他の金融商品にも投資する。これらの商品は、主に、短期米国債で構成されることが見込まれるが、政府、企業または他の団体の債券を含むことがある。
投資顧問会社	Winton Capital Management Limited

投資先ファンドの名称	Two Sigma Investment Fund Ltd.
運用の基本方針	Two Sigma Absolute Return Macro Enhanced Cayman Fund, Ltd.の投資目的は、主として、投資運用会社により運用され、複数のモデル主導型投資戦略と投資運用会社独自のリスク・マネジメント手法および執行手法の活用を組み合わせた一または複数の取引主体への投資を通じて、米ドル建の絶対リターンを達成することである。
投資対象	流動性のある金融商品（先物、先物オプション、現物取引、先渡、ETF（株式指数またはセクター指数に係るものを含む。））、外国為替取引、債券、通貨契約、国債、ワラント、オプション（上場オプションおよび店頭オプションのいずれも）、レポ取引、逆レポ取引、スワップ（株式スワップ、商品スワップ、金利スワップ、通貨スワップ、先物類似スワップ、クレジット・デフォルト・スワップを含むすべての種類）、外国為替取引に係るオプション、商品、米国および非米国マネー・マーケット・ファンドおよび短期金融商品（財務省その他の政府機関債、地方債、社債、定期預金、約束手形およびユーロ・ドル・デポジットを含む。）、通貨に係るノンデリバラブル・フォワードならびに既存のまたは将来設定されるデリバティブまたは金融商品をいう。）
投資運用会社	Two Sigma Advisers, LLC