

【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29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・ヘッド代行 スティーブン・ルーセル
(Stephen Rouxel)

【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
弁護士 依田俊一

【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562億1,000万円)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598億5,000万円)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28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=122.42円および1ユーロ=119.70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29年4月28日に半期報告書を提出いたしましたので、平成29年1月31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・アドバンテージ・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29年2月末日現在)

| 資産の種類 | 国・地域名 | 時価合計(米ドル) | 投資比率(%) |
|--------------|-----------|------------------------------|---------|
| 投資信託 | ケイマン諸島 | 26,789,994.97 | 40.48 |
| | 英領ヴァージン諸島 | 16,229,384.94 | 24.52 |
| | バミューダ | 11,514,507.16 | 17.40 |
| | ルクセンブルグ | 4,836,702.44 | 7.31 |
| | アイルランド共和国 | 4,417,393.48 | 6.67 |
| | 小計 | 63,787,982.99 | 96.37 |
| 現金その他の資産(負債) | | 2,400,568.48 | 3.63 |
| 合 計(純資産総額) | | 66,188,551.47 (約7,450百万円) | 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29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 Evolution - Class A1 Evolution USD | ケイマン諸島 | 投資 信託 | 7,100,947.01 | 1.02 | 7,237,285.19 | 1.60 | 11,393,274.71 | 17.21 |
| 2 | Tewksbury Investment Fund Ltd. - Class B | バミューダ | 投資 信託 | 457.27 | 13,535.94 | 6,189,624.37 | 19,664.40 | 8,992,007.16 | 13.59 |
| 3 | Winton Futures Fund Ltd - Class B - Lead Series | 英領ヴァージン 諸島 | 投資 信託 | 7,473.62 | 460.39 | 3,440,779.91 | 1,015.65 | 7,590,550.96 | 11.47 |
| 4 | Two Sigma Compass Enhanced Cayman Fund, Ltd - Class A1 Benchmark Series | ケイマン諸島 | 投資 信託 | 1,157.22 | 3,831.89 | 4,434,334.60 | 6,080.30 | 7,036,239.90 | 10.63 |
| 5 | Two Sigma Absolute Return Macro Enhanced Cayman Fund, Ltd. - Class A1 Series 1 Benchmark | ケイマン諸島 | 投資 信託 | 4,572.24 | 1,000.00 | 4,572,239.20 | 1,485.09 | 6,790,201.80 | 10.26 |
| 6 | Transtrend Fund Alliance Omnitrend - USD | ルクセンブルグ | 投資 信託 | 2,066.33 | 2,008.74 | 4,150,706.44 | 2,340.73 | 4,836,702.44 | 7.31 |
| 7 | Crabel Fund SPC, Ltd. - Class A - Fee 2 - Series 95 | 英領ヴァージン 諸島 | 投資 信託 | 4,922.80 | 1,000.00 | 4,922,795.30 | 980.01 | 4,824,392.50 | 7.29 |
| 8 | MS Lynx UCITS Fund - Class B USD | アイルランド 共和国 | 投資 信託 | 4,953.40 | 984.88 | 4,878,505.58 | 891.79 | 4,417,393.48 | 6.67 |
| 9 | Tewksbury Investment Fund Ltd. - Sub USD Feb 17 | バミューダ | 投資 信託 | 2,500,000.00 | 1.00 | 2,500,000.00 | 1.01 | 2,522,500.00 | 3.81 |
| 10 | Winton Futures Fund Ltd - Class B - Feb 17 Series | 英領ヴァージン 諸島 | 投資 信託 | 23,000.00 | 100.00 | 2,300,000.00 | 102.07 | 2,347,610.78 | 3.55 |
| 11 | AHL Evolution Frontier Fund Ltd. - Class A USD | ケイマン諸島 | 投資 信託 | 1,452,751.00 | 0.97 | 1,416,286.95 | 1.08 | 1,570,278.56 | 2.37 |
| 12 | Crabel Fund SPC, Ltd. - Class A - Fee 2 - Series 231 | 英領ヴァージン 諸島 | 投資 信託 | 1,500.00 | 1,000.00 | 1,500,000.00 | 977.89 | 1,466,830.70 | 2.22 |

(ロ) 投資不動産物件

平成29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29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29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。

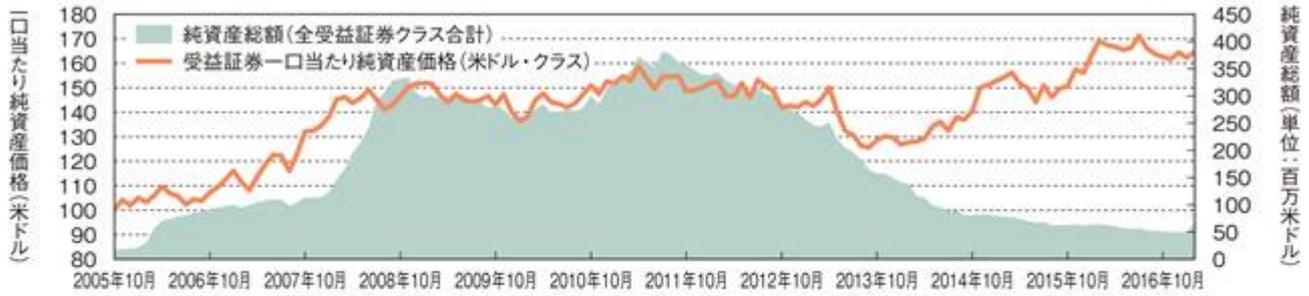
| | 純資産総額 | | 一口当たり純資産価格 | | |
|-----------|--------|-------|------------|---------|--------|
| | 千米ドル | 百万円 | クラス | 米ドル/ユーロ | 円 |
| 平成28年3月末日 | 62,974 | 7,088 | USD | 167.46 | 18,849 |
| | | | EUR | 151.86 | 18,068 |
| 4月末日 | 60,528 | 6,813 | USD | 166.76 | 18,771 |
| | | | EUR | 151.09 | 17,977 |
| 5月末日 | 57,508 | 6,473 | USD | 165.46 | 18,624 |
| | | | EUR | 149.76 | 17,818 |
| 6月末日 | 54,975 | 6,188 | USD | 166.35 | 18,724 |
| | | | EUR | 150.38 | 17,892 |
| 7月末日 | 54,256 | 6,107 | USD | 171.11 | 19,260 |
| | | | EUR | 154.52 | 18,385 |
| 8月末日 | 52,695 | 5,931 | USD | 166.18 | 18,705 |
| | | | EUR | 149.88 | 17,833 |
| 9月末日 | 52,141 | 5,869 | USD | 163.84 | 18,442 |
| | | | EUR | 147.60 | 17,561 |
| 10月末日 | 50,848 | 5,723 | USD | 162.65 | 18,308 |
| | | | EUR | 146.25 | 17,401 |
| 11月末日 | 49,755 | 5,600 | USD | 161.69 | 18,200 |
| | | | EUR | 145.17 | 17,272 |
| 12月末日 | 50,616 | 5,697 | USD | 164.41 | 18,506 |
| | | | EUR | 147.21 | 17,515 |
| 平成29年1月末日 | 49,690 | 5,593 | USD | 162.22 | 18,259 |
| | | | EUR | 145.05 | 17,258 |
| 2月末日 | 66,189 | 7,450 | USD | 164.78 | 18,548 |
| | | | EUR | 147.23 | 17,517 |

(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。

< 参考情報 >

■ 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2017年2月28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2017年2月28日まで)

■ファンドの分配金再投資純資産価格・年間騰落率の推移

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)



2012年3月 2013年3月 2014年3月 2015年3月 2016年3月

※分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであるが、ファンドは分配金を支払っていないため、受益証券1口当たり純資産価格と同一である。以下同じ。

※年間騰落率は、2012年3月から2017年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものである。以下同じ。

<各資産クラスの指数>

日本株…東証株価指数(TOPIX)(配当込)

先進国株…MSCI-KOKUSAI指数(配当込)(米ドルベース)

新興国株…MSCIエマージングマーケット・インデックス(配当込)(米ドルベース)

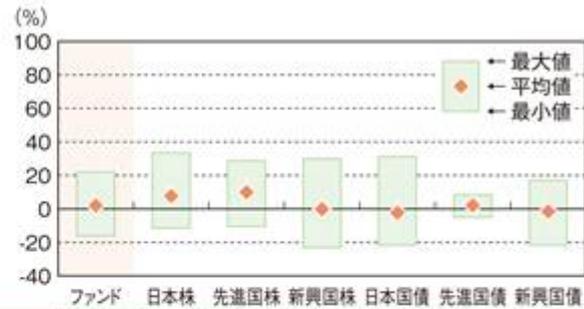
日本国債…JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(米ドルベース)

先進国債…JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(除く日本)(米ドルベース)

新興国債…JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・レティバース・ファイド(米ドルベース)

※日本株の指数は、各月末時点の為替レートにより米ドル換算している。

■ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

| | ファンド | 日本株 | 先進国株 | 新興国株 | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債 |
|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|
| 最大値(%) | 21.9% | 33.6% | 28.7% | 29.9% | 31.2% | 8.4% | 17.1% |
| 最小値(%) | -16.1% | -11.4% | -10.6% | -23.1% | -21.6% | -4.9% | -21.5% |
| 平均値(%) | 2.1% | 7.7% | 10.0% | -0.1% | -2.3% | 2.1% | -1.5% |

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限らない。

※上記は2012年3月から2017年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものである。

※このグラフは、サブ・ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものである。

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)



2012年3月 2013年3月 2014年3月 2015年3月 2016年3月

※分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであるが、ファンドは分配金を支払っていないため、受益証券1口当たり純資産価格と同一である。以下同じ。

※年間騰落率は、2012年3月から2017年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものである。以下同じ。

<各資産クラスの指数>

日本株…東証株価指数(TOPIX)(配当込)

先進国株…MSCI-KOKUSAI指数(配当込)(ユーロベース)

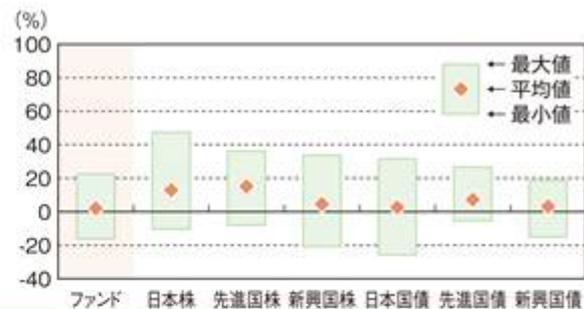
新興国株…MSCIエマージングマーケット・インデックス(配当込)(ユーロベース)

日本国債…JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(ユーロベース)

先進国債…JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(除く日本)(ユーロベース)

新興国債…JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・レティバース・ファイド(ユーロベース)

※日本株の指数は、各月末時点の為替レートによりユーロ換算している。



ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

| | ファンド | 日本株 | 先進国株 | 新興国株 | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債 |
|--------|--------|--------|-------|--------|--------|-------|--------|
| 最大値(%) | 22.4% | 47.4% | 36.1% | 33.8% | 31.5% | 26.6% | 18.5% |
| 最小値(%) | -16.1% | -10.3% | -8.1% | -20.6% | -25.7% | -5.3% | -14.9% |
| 平均値(%) | 2.0% | 13.0% | 15.1% | 4.7% | 2.6% | 7.2% | 3.2% |

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限らない。

※上記は2012年3月から2017年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものである。

※このグラフは、サブ・ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものである。

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28年2月末日現在の一口 当たり純資産価格 (米ドル) | 平成29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28年3月1日～ 平成29年2月末日 | 169.00 | 164.78 | - 2.50 |

(ユーロ・クラス)

| | 平成28年2月末日現在の一口 当たり純資産価格 (ユーロ) | 平成29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28年3月1日～ 平成29年2月末日 | 153.35 | 147.23 | - 3.99 |

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

a = 平成29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28年2月末日現在の一口当たり純資産価格 (分配落の額)

< 参考情報 >

■ 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、2017年については、2017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(分配落の額)

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。

2017年については、2017年1月1日から2017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、2017年については、2017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(分配落の額)

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。

2017年については、2017年1月1日から2017年2月末日までの収益率。

2 販売及び買戻しの実績

平成29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29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 |
|------------------------|--------------------------|---------------------------|
| 8,423.72 (4,332.94) | 53,117.37 (18,300.90) | 251,393.79 (33,325.09) |

(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29年2月28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) | 870.94 (0.00) | 3,585.56 (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29年2月28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 = 112.56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。

[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

2017年1月31日現在

(未監査)

| | 2017年1月31日 | | 2016年7月31日 | |
|-----------------------|-----------------|----------------|----------------|--------------|
| | 千米ドル | 百万円 | 千米ドル | 百万円 |
| 資産 | | | | |
| 流動資産 | | | | |
| 組入投資有価証券 | 53,236 | 5,992 | 60,358 | 6,794 |
| 債権 | 24,775 | 2,789 | 1,404 | 158 |
| 現金および現金等価物 | 2,589 | 291 | 24 | 3 |
| | <u>27,364</u> | <u>3,080</u> | <u>1,428</u> | <u>161</u> |
| 資産合計 | <u>80,600</u> | <u>9,072</u> | <u>61,786</u> | <u>6,955</u> |
| 負債 | | | | |
| 債務：一年以内に期限の到来する金額 | (16,663) | (1,876) | (7,530) | (848) |
| 負債合計 | <u>(16,663)</u> | <u>(1,876)</u> | <u>(7,530)</u> | <u>(848)</u> |
| 買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純資産 | <u>63,937</u> | <u>7,197</u> | <u>54,256</u> | <u>6,107</u> |

連結総収益計算書
2017年1月31日に終了した6か月間
(未監査)

| | 自2016年8月1日 至2017年1月31日 | | 自2015年8月1日 至2016年1月31日 | |
|-------------------------------------|---------------------------|-------|---------------------------|-------|
| | 千米ドル | 百万円 | 千米ドル | 百万円 |
| 収益： | | | | |
| 純キャピタル（ロス）/ゲイン | (3,099) | (349) | 4,752 | 535 |
| 財務費用：支払利息 | (38) | (4) | (23) | (3) |
| 運用費用 | (152) | (17) | (895) | (101) |
| 純費用 | (190) | (21) | (918) | (103) |
| 買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純 資産の投資活動による変動 | (3,289) | (370) | 3,834 | 432 |

すべての業績は、継続的な業務から発生している。

ファンドは、その他包括利益の内訳項目を有していないため、買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純資産の変動は、当期包括利益合計を反映している。

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
2017年1月31日に終了した6か月間
(未監査)

| | 自2016年8月1日 至2017年1月31日 | | 自2015年8月1日 至2016年1月31日 | |
|-------------------------------------|---------------------------|-------|---------------------------|-------|
| | 千米ドル | 百万円 | 千米ドル | 百万円 |
| 期首現在の買戻可能参加受益証券保有者に 帰属する純資産 | 54,256 | 6,107 | 68,429 | 7,702 |
| 買戻可能参加受益証券の発行および買戻し による変動： | | | | |
| 発行受領額 / 未収額 | 16,558 | 1,864 | 59 | 7 |
| 控除：買戻支払額 / 未払額 | (3,588) | (404) | (8,840) | (995) |
| | 12,970 | 1,460 | (8,781) | (988) |
| 買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純 資産の投資活動による変動 | (3,289) | (370) | 3,834 | 432 |
| 期末現在の買戻可能参加受益証券保有者に 帰属する純資産 | 63,937 | 7,197 | 63,482 | 7,146 |

(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

投資有価証券明細表

2017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 (2016年7月31日 : 111.25%) | | | |
| AHL (Cayman) SPC - Class A1 Evolution USD Shares | 5,756,340 | 9,066 | 14.19% |
| AHL Evolution Frontier Fund | 1,452,751 | 1,523 | 2.38% |
| Crabel Fund SPC Ltd. - Segregated Portfolio - Series 95 | 4,923 | 4,933 | 7.72% |
| MS Lynx UCITS Fund USD - Class B | 4,953 | 4,223 | 6.60% |
| Tewksbury Investments Fund | 457 | 8,908 | 13.93% |
| Transtrend Fund Alliance - Omnitrend (USD) | 1,617 | 3,601 | 5.63% |
| Two Sigma Compass Enhanced Cayman Fund Ltd. GSY | 1,157 | 7,010 | 10.96% |
| Two Sigma Investment Fund Ltd. - Class A | 4,572 | 6,572 | 10.28% |
| Winton Futures Fund Ltd. - Class B | 7,474 | 7,400 | 11.57% |
| 組入投資有価証券 | | 53,236 | 83.26% |
| Discus Non US Side Holdings Ltd. - Class S | 11,076 | - * | - |
| 純流動資産 | | 10,701 | 16.74% |
| 純資産総額 | | 63,937 | 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。

| | 2017年 1 月31日 | 2016年 7 月31日 | 2015年 7 月31日 |
|-----------------|--------------|--------------|--------------|
| 発行済買戻可能参加受益証券口数 | | | |
| 米ドル・クラス | 251,393.79 | 259,179.91 | 311,515.53 |
| ユーロ・クラス | 3,585.58 | 3,961.79 | 5,007.39 |
| スターリング・クラス | 10.56 | 2,099.43 | 2,535.07 |
| ユーロ・Rクラス | 1,075.61 | 596.70 | 3,564.09 |
| 米ドル・Rクラス | 5,512.00 | 5,512.00 | 22,124.22 |
| スターリング・Rクラス | 44,423.33 | 48,035.56 | 100,022.11 |
| 米ドル・Sクラス* | 92,288.50 | - | - |
| スターリング・Sクラス** | 51,396.46 | - | - |
| ユーロ・Sクラス*** | 8,315.69 | - | - |
| 一口当たり純資産価格 | | | |
| 米ドル・クラス | 162.21米ドル | 171.11米ドル | 151.04米ドル |
| ユーロ・クラス | 145.04ユーロ | 154.52ユーロ | 137.19ユーロ |
| スターリング・クラス | 150.20英ポンド | 166.94英ポンド | 146.97英ポンド |
| ユーロ・Rクラス | 114.27ユーロ | 121.50ユーロ | 106.89ユーロ |
| 米ドル・Rクラス | 118.76米ドル | 124.67米ドル | 109.09米ドル |
| スターリング・Rクラス | 120.32英ポンド | 126.58英ポンド | 110.55英ポンド |
| 米ドル・Sクラス* | 98.81米ドル | - | - |
| スターリング・Sクラス** | 81.79英ポンド | - | - |
| ユーロ・Sクラス*** | 93.37ユーロ | - | - |

* 当該受益証券クラスは、2016年12月30日に開始された。

** 当該受益証券クラスは、2016年11月30日に開始された。

*** 当該受益証券クラスは、2017年 1 月31日に開始された。

| | 2017年 1 月31日 | 2016年 7 月31日 | 2015年 7 月31日 |
|-------------------------|--------------|--------------|--------------|
| 純資産総額 | | | |
| 米ドル・クラス (千米ドル) | 40,779 | 44,346 | 47,050 |
| ユーロ・クラス (千ユーロ) | 520 | 612 | 687 |
| スターリング・クラス (千英ポンド) | 2 | 350 | 373 |
| ユーロ・Rクラス (千ユーロ) | 123 | 72 | 381 |
| 米ドル・Rクラス (千米ドル) | 655 | 687 | 2,413 |
| スターリング・Rクラス (千英ポンド) | 5,345 | 6,080 | 11,057 |
| 米ドル・Sクラス (千米ドル)* | 9,119 | - | - |
| スターリング・Sクラス (千英ポンド)** | 4,204 | - | - |
| ユーロ・Sクラス (千ユーロ)*** | 776 | - | - |

ポートフォリオの分類

| | ポートフォリオ における比率 |
|---------|-------------------|
| 上場有価証券 | 24.69 |
| 未上場有価証券 | 75.31 |
| | <u>100.00%</u> |

| 投資先別配分 | 2017年 1 月31日 | 2016年 7 月31日 |
|---------------|----------------|----------------|
| マネーゾド・フューチャーズ | 100.00% | 100.00% |
| 合計 | <u>100.00%</u> | <u>100.00%</u> |

* 当該受益証券クラスは、2016年12月30日に開始された。

** 当該受益証券クラスは、2016年11月30日に開始された。

*** 当該受益証券クラスは、2017年 1 月31日に開始された。

重要なポートフォリオの変動の概要
2017年1月31日に終了した6か月間 (未監査)

購入

| | 額面保有高 | 取得原価 千円ドル |
|------|-------|--------------|
| 購入合計 | 1,095 | 950 |

売却

| | 額面保有高 | 手取額 千円ドル |
|------|---------|-------------|
| 売却合計 | 320,299 | 5,495 |

* 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。

2017年1月31日終了年度中、その他の購入および売却はなかった。

2016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29年2月末日現在、100,000英ポンド(約1,398万円)

(注)英ポンドの円貨換算額は、平成29年2月28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=139.81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29年2月末日現在、以下のとおり、4本の投資信託(合計純資産総額約2,230.0百万米ドル)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29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 | 1,996.0 |
| 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 | 66.0 |
| 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 | 49.0 |
| 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 | 119.0 |

(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。

別紙 A

< 訂正前 >

(前略)

9 投資先ファンド

平成28年11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。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

9 投資先ファンド

平成29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。

(後略)