

2015年12月18日

受益者のみなさまへ

クレディ・スイス・マネジメント（ケイマン）リミテッド

ケイマン籍オープン・エンド契約型外国投資信託
「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－
RPMマネージド・フューチャーズ連動ファンドⅢ（償還時豪ドル建
元本確保型）」
の信託終了（強制償還）のお知らせ

拝啓 時下ますますご清祥のこととお慶び申し上げます。

平素は格別のご高配を賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、ケイマン籍オープン・エンド契約型外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－RPMマネージド・フューチャーズ連動ファンドⅢ（償還時豪ドル建元本確保型）」（以下「当ファンド」といいます。）につきまして、このたび、当ファンドの管理会社であるクレディ・スイス・マネジメント（ケイマン）リミテッド（以下「管理会社」といいます。）が当ファンドのすべての受益証券の強制償還を決定し、2016年3月22日をもって当ファンドを終了することとなりましたので、お知らせいたします。なお、本書面は、投資信託及び投資法人に関する法律第59条により準用される同法第20条・第17条の規定に基づき、受益者の皆様にお送りするものです。

敬具

記

1. 外国投資信託の信託契約の解約の理由

当ファンドの評価日にあたる2015年10月30日、当ファンドの純資産総額が2,000万豪ドルを下回りました。そのため、当ファンドの管理会社は、当ファンドの設立証書（以下「本設立証書」といいます。）第8条および補遺目論見書に基づき、当ファンドのすべての受益証券を強制償還する旨決定いたしました。当ファンドは、すべての受益証券の強制償還が行われた場合、本設立証書第9条および補遺目論見書の規定に従い、終了いたします。強制償還日は、2016年3月22日を予定しており、2016年2月29日における受益証券一口当たり純資産価格と同額で強制償還が行われる予定です。

2. 外国投資信託の信託契約の解約の相当性に関する事項

当ファンドの補遺目論見書は、ある評価日における純資産価額が2,000万豪ドルを下回り、管理会社が3か月以上前に全受益者に通知し、ファンドの終了を決定した場合、当ファンドを終了することができる旨を定めており、かかる定めに基づき、管理会社は、すべての受益証券を強制償還することを決定いたしました。よって、当外国投資信託の信託契約の解約は相当なものと考えております。

3. 外国投資信託の信託契約の解約がその効力を生ずる日

2016年3月22日（火）

なお、買戻請求の受付最終日は、以下のとおり予定しております。

買戻請求受付最終日： 2016年1月13日（水）
買戻最終日： 2016年2月22日（月）

4. 直前に作成された財産状況開示資料等の内容

別添をご参照ください。

5. 財産状況開示資料等を作成した後に、重要な外国投資信託の信託財産に属する財産の処分、重大な信託財産責任負担債務の負担その他の外国投資信託の信託財産の状況に重要な影響を与える事象が生じたときは、その内容

該当事項はありません。

6. 外国投資信託の信託契約の解約に関する事項について受益者の不利益となる事実

該当事項はありません。

以上

(別添) 財産状況開示資料

(1) 貸借対照表

未監査貸借対照表

2015年8月31日

(豪ドルで表示)

	注記	2015年8月31日現在		2015年2月28日現在	
		豪ドル	千円	豪ドル	千円
資産					
投資 (公正価値) (取得価格 : 2015年8月31日6,186,156豪ドル ; 2015年2月28日7,225,980豪ドル)	3,7	7,694,808	646,826	9,454,716	794,763
現金および現金同等物		4,121	346	4,724	397
投資売却による未収入金		255,213	21,453	217,634	18,294
		7,954,142	668,625	9,677,074	813,455
負債					
未払報酬代行報酬	4	2,373	199	2,745	231
未払代行協会員報酬	4	738	62	854	72
未払販売会社報酬	4	738	62	854	72
		3,849	324	4,453	374
純資産		7,950,293	668,302	9,672,621	813,081
純資産の内訳					
受益者資本	5	2,436,975	204,852	3,723,553	313,002
利益剰余金		5,513,318	463,450	5,949,068	500,079
		7,950,293	668,302	9,672,621	813,081
発行済受益証券64,170口 (2015年2月28日74,220口) を 基準とする受益証券1口当たり					
純資産価値	5	123.89	10	130.32	11

(2) 損益計算書

未監査損益計算書

2015年8月31日に終了した半期
(豪ドルで表示)

	注記	2015年8月31日に 終了した半期		2014年8月31日に 終了した半期	
		豪ドル	千円	豪ドル	千円
投資収益					
受取利息	3	25,844	2,172	37,170	3,125
費用					
報酬代行報酬	4	15,675	1,318	21,714	1,825
代行協会員報酬	4	5,084	427	7,726	649
販売会社報酬	4	5,084	427	7,726	649
		25,843	2,172	37,166	3,124
投資純益		1	0	4	0
投資に係る実現・未実現純 (損) 益					
投資に係る実現純益	3	284,333	23,901	263,705	22,167
投資に係る未実現損失の変動額	3	(720,084)	(60,530)	(146,057)	(12,278)
		(435,751)	(36,629)	117,648	9,889
運用による純資産の増(減)額		(435,750)	(36,629)	117,652	9,890