

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（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（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
<b>資産</b>					
投資（公正価値）（取得 価格：2015年8月31日 5,762,069豪ドル；2015 年2月28日 6,810,422豪 ドル）	3,7	7,148,514	600,904	8,911,051	749,063
現金および現金同等物		3,805	320	4,402	370
投資売却による未収入金		98,624	8,290	26,004	2,186
		7,250,943	609,514	8,941,457	751,619
<b>負債</b>					
未払報酬代行報酬	4	2,175	183	2,542	214
未払代行協会員報酬	4	676	57	791	66
未払販売会社報酬	4	676	57	791	66
		3,527	296	4,124	347
<b>純資産</b>					
		7,247,416	609,218	8,937,333	751,272
<b>純資産の内訳</b>					
受益者資本	5	3,365,451	282,900	4,627,269	388,968
利益剰余金		3,881,965	326,318	4,310,064	362,304
		7,247,416	609,218	8,937,333	751,272
<b>発行済受益証券58,786口 （2015年2月28日68,736 口）を基準とする受益証 券1口当たり純資産価値</b>					
	5	123.28	10	130.02	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
<b>投資収益</b>					
受取利息	3	24,810	2,086	35,288	2,966
<b>費用</b>					
報酬代行報酬	4	15,042	1,264	20,614	1,733
代行協会員報酬	4	4,884	411	7,335	617
販売会社報酬	4	4,884	411	7,335	617
		24,810	2,086	35,284	2,966
<b>投資純益</b>		-	-	4	0
<b>投資に係る実現・未実現純 (損) 益</b>					
投資に係る実現純益	3	286,085	24,048	241,324	20,286
投資に係る未実現損失の純変 動額	3	(714,184)	(60,034)	(44,167)	(3,713)
		(428,099)	(35,986)	197,157	16,573
<b>運用による純資産の増 (減) 額</b>		(428,099)	(35,986)	197,161	16,573