

1. 会社概要（基本情報）

| | | |
|-------------|--|---|
| 会社名 | Monterey Capital Management Japan 株式会社 | |
| 所在地 | 住所 | 〒104-0042東京都中央区入船一丁目3番9号長崎ビル8F |
| | 電話 | 03-6731-9358 |
| | H P アドレス | https://www.moncapi.jp/ |
| 代表者 | 蛭田和彦 | |
| 金融商品取引業登録番号 | 関東財務局長（金商）第3434号 | |
| 登録年月日 | 2024/10/9 | |
| 協会会員番号 | 012-03075 | |
| 業務開始年月 | 2024/11/8 | |
| 資本金 | 5000万円 | |
| 受付窓口 | 蛭田和彦 | |
| 電話 | 03-6731-9358（代表） | |
| E-mail アドレス | info@moncapi.com | |

2. 運用の特色（投資哲学、運用スタイル等）

Monterey Capital Management Japan株式会社は、シンガポール金融庁（MAS）より資本市場サービスライセンス（CMSライセンス）の交付を受けたMonterey Capital Management Pte. Ltd.が100%出資する運用会社です。

当社グループは「リスク調整後リターンの最大化」を基本理念とし、グローバル市場において柔軟かつ独自性の高い運用戦略を構築・展開しています。現在、以下の3つの戦略を主軸として運用を行っています。

米国リノベロン戦略

米国の中古住宅市場におけるリノベーション資金を対象とした短期貸付。1年間のロックアップ期間を設けており、10万米ドル（または相当額の円）から投資可能です。

英国訴訟ファイナンス

情報格差に起因する消費者保護訴訟を支援する戦略です。安定的かつ再現性のあるリターンを期待できる点が特徴です。

日本株ロング・ショート戦略

日本株式市場を対象に、ロング・ショートを組み合わせたアクティブ戦略を実施しています。市場中立的な姿勢を保ちつつ、超過収益の獲得を目指します。

当社は、グローバルな知見と国内市場への深い理解を融合し、日本の投資家の皆さまに分散性と持続可能性に優れた運用機会を提供しています。

3. 投資に関する意思決定プロセス

投資運用の実行体制

当社は、信託契約を締結している信託会社等に対し、Monterey Capital Management Pte. Ltd.が運用する外国投資信託の受益証券への投資を指図する形態で投資運用業務を行っています。

投資意思決定とガイドラインの策定

ポートフォリオ・マネジャーは、投資一任契約に基づき、顧客の投資方針およびリスク許容度を踏まえた投資ガイドラインを作成します。作成後は取締役会の承認を経て、ガイドラインに沿った運用を実施しています。運用にあたっては、過度に投機的な取引を避け、適切なリスク管理を徹底しています。

リスク・コンプライアンス体制

運用部門は、投資先ファンドからの定期報告等をもとに、運用状況を随時確認しています。コンプライアンス・アドミニストレーション部門は、契約内容・関連法令・社内規程に沿った運用がなされているかをモニタリングしています。また、ファンドの基準価額や監査体制については、信託銀行やファンドアドミニストレーターとの情報連携を通じて定期的に確認しています。

4. 運用体制

Monterey Capital Managementは、日本法人とシンガポール法人の連携により、投資一任契約に基づく運用を行っています。

日本では、投資家（年金基金など）がMonterey Capital Management Japan株式会社と投資一任契約を結び、日本法人が信託銀行を通じて運用指示を行います。

その運用指示に基づき、シンガポールの親会社であるMonterey Capital Management Pte. Ltd.がファンドマネジメントを担い、自社ファンドまたは外部運営ファンドへ投資します。ファンドの管理業務は、EliauやCitco Trustiesなどの業務受託会社が担当します。

5. 運用金額

詳細は当社に直接お問い合わせください。

6. 運用実績

当社は特定投資家向けに、投資一任契約に基づく運用サービスを提供しています。外国籍投資信託を組み入れる際、以下の投資戦略を提供しています。

■ エメラルド・ヒル・パートナーズ・ファンド | 米ドルクラス | 米国リノベロン戦略 | 2020年8月運用開始

| | 1月 | 2月 | 3月 | 4月 | 5月 | 6月 | 7月 | 8月 | 9月 | 10月 | 11月 | 12月 | 年次 |
|-------|--------|----|--------|----|--------|----|--------|----|----|-----|-----|-----|---------|
| 2020年 | - | | - | | - | | +0.07% | | | | | | +0.07% |
| 2021年 | +0.91% | | +1.41% | | +2.93% | | +1.58% | | | | | | +7.00% |
| 2022年 | +2.03% | | +1.14% | | +1.01% | | +2.11% | | | | | | +6.43% |
| 2023年 | +3.11% | | +2.82% | | +4.49% | | +0.43% | | | | | | +11.25% |
| 2024年 | +3.28% | | +1.41% | | +2.51% | | +2.00% | | | | | | +9.51% |
| 2025年 | +2.02% | | +1.00% | | | | | | | | | | +3.04% |
| | 設定来 | | | | | | | | | | | | +43.07% |

■ モントレー・ジャパン・エクィティ・マスター・ファンド | 米ドルLINKクラス | 訴訟ファイナンス | 2024年4月運用開始

| % | 1月 | 2月 | 3月 | 4月 | 5月 | 6月 | 7月 | 8月 | 9月 | 10月 | 11月 | 12月 | 年次 | |
|------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|--------|---------|--------|
| 2025 | 2.92% | 3.08% | 5.97% | 17.06% | 15.47% | 11.42% | | | | | | | | 69.32% |
| 2024 | - | - | - | 2.21% | 0.21% | 2.04% | 0.11% | -0.05% | 1.58% | -0.22% | 0.10% | 27.70% | 35.49% | |
| | 設定来 | | | | | | | | | | | | 129.41% | |

※いずれも運用報酬控除後のネットリターンです。通貨建て（円・米ドル）や分配型の有無など、多様な選択肢をご用意しています。詳細は info@moncapi.com までお気軽にお問い合わせください。

7. アピールポイント

当社の親会社であるMonterey Capital Management Pte. Ltd.は、2006年に日本で創業し、日本株ロング・ショート戦略を中心とした投資助言・代理業務を通じて、主に企業年金基金向けにサービスを提供してきました。その後、2008年にシンガポールへ拠点を移し、税制面・運用面での優位性を活かしながら、海外の年金基金等からの受託を拡大しています。

現在当社が提供するオルタナティブ戦略は、「比較的少額から投資可能であること」および「ロックアップ期間が短いこと」を特長としています。以下の通り、魅力ある条件での投資機会を提供しています。

- ・米国リノベロン戦略：10万米ドル または相当額（円）／ロックアップ期間：1年
- ・英国訴訟ファイナンス：10万米ドル／ロックアップ期間：6か月

当社は、これまでに培ってきた日本およびシンガポールでの経験と実績を活かし、今後も多様かつ革新的な投資戦略を日本のお客様に提供してまいります。

また、日本市場における信頼関係を一層深め、透明性の高い運用体制を通じて、お客様に安心してご利用いただける資産運用サービスの提供を目指しています。当社の成長を通じ、資産運用分野における日本全体のプレゼンス向上にも貢献していきたいと考えています。