

投資家の皆様へ

2020年9月30日

UBS アセット・マネジメント株式会社

信用リスク集中回避のための対応実施のお知らせ

平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

弊社が設定・運用しております以下のファンドは、一般社団法人投資信託協会の定める「投資信託等の運用に関する規則」第17条の2で規定する、信用リスク集中回避のための投資制限を超過したため、同条の規定に従って基準比率以内となるよう調整を行ない、それを完了致しました。同協会の定める「投資信託及び投資法人に係る運用報告書等に関する規則」第19条の2の規定に基づき、ここにお知らせいたします。

敬具

記

対象ファンド名	対象発行体名	投資制限超過日	調整終了日
UBS 中国新時代株式ファンド (年1回決算型)	TAL Education Group	2020年8月5日	2020年8月6日
UBS 中国新時代株式ファンド (年2回決算型)	Tencent Holdings Ltd	2020年8月6日	2020年8月7日
UBS 中国新時代株式ファンド (年1回決算型)	Tencent Holdings Ltd	2020年8月6日	2020年8月12日
UBS 中国新時代株式ファンド (年1回決算型)	Alibaba Group Holding Ltd	2020年8月7日	2020年8月12日
UBS 合併裁定戦略ファンド (SMA 専用)	E*TRADE Financial Corp	2020年8月13日	2020年8月14日
UBS 中国 A 株ファンド (年1回決算型)	Ping An Bank Co Ltd	2020年8月18日	2020年8月19日
UBS 中国 A 株ファンド (年4回決算型)	Ping An Bank Co Ltd	2020年8月18日	2020年8月19日
UBS 中国 A 株ファンド (年4回決算型)	Wuliangye Yibin Co Ltd	2020年8月18日	2020年8月19日
UBS 中国 A 株ファンド (年4回決算型)	China Merchants Bank Co Ltd	2020年8月18日	2020年8月19日
UBS 中国 A 株ファンド (年1回決算型)	Wuliangye Yibin Co Ltd	2020年8月18日	2020年8月21日
UBS 中国 A 株ファンド (年4回決算型)	Kweichow Moutai Co Ltd	2020年8月19日	2020年8月20日
UBS 中国 A 株ファンド (年4回決算型)	Ping An Bank Co Ltd	2020年8月20日	2020年8月21日
UBS 中国 A 株ファンド (年4回決算型)	Wuliangye Yibin Co Ltd	2020年8月20日	2020年8月21日

対象ファンド名	対象発行体名	投資制限超過日	調整終了日
UBS 中国 A 株ファンド (年 1 回決算型)	Wuliangye Yibin Co Ltd	2020 年 8 月 26 日	2020 年 8 月 27 日
UBS 中国 A 株ファンド (年 4 回決算型)	Wuliangye Yibin Co Ltd	2020 年 8 月 26 日	2020 年 8 月 28 日
UBS 中国 A 株ファンド (年 4 回決算型)	Kweichow Moutai Co Ltd	2020 年 8 月 27 日	2020 年 8 月 28 日
UBS 中国 A 株ファンド (年 4 回決算型)	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd	2020 年 8 月 27 日	2020 年 8 月 28 日
UBS 中国新時代株式ファンド (年 2 回決算型)	Alibaba Group Holding Ltd	2020 年 8 月 27 日	2020 年 8 月 31 日
UBS 中国新時代株式ファンド (年 1 回決算型)	Alibaba Group Holding Ltd	2020 年 8 月 27 日	2020 年 8 月 31 日
UBS 中国 A 株ファンド (年 1 回決算型)	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd	2020 年 8 月 27 日	2020 年 8 月 31 日

商号 UBS アセット・マネジメント株式会社
 登録番号 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 412 号
 加入協会 一般社団法人 日本投資顧問業協会
 一般社団法人 投資信託協会
 一般社団法人 第二種金融商品取引業協会

© UBS 2020. キーシンボル及び UBS の各標章は、UBS の登録又は未登録商標です。UBS は全ての権利を留保します。

ご参考「一般社団法人 投資信託協会 定款・諸規則集」より抜粋

「投資信託等の運用に関する規則」

(信用リスク集中回避のための投資制限) 第 17 条の 2

金商業等府令第 130 条第 1 項第 8 号の 2 に定める信用リスクを適正に管理する方法としてあらかじめ金融商品取引業者等が定めた合理的な方法は、一の者に係るエクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率が次に掲げる区分(※)ごとにそれぞれ 10%、合計で 20%を超えることのないように運用すること、及び価格、金利、通貨若しくは投資信託財産の純資産総額の変動等により当該比率を超えることとなった場合に、超えることとなった日から 1 ヶ月以内に当該比率以内となるよう調整を行い、通常の対応で 1 ヶ月以内に調整を行うことが困難な場合には、その事跡を明確にした上で、できる限り速やかに当該比率以内に調整を行う方法とする。ただし、証券投資信託の設定当初、解約及び償還への対応並びに投資環境等の運用上やむを得ない事情があるときは、この限りではない。

※(1)株式等エクスポージャー (2)債券等エクスポージャー (3)デリバティブ等エクスポージャー

※部分に関しては、弊社の注記となります。

「投資信託及び投資法人に係る運用報告書等に関する規則」

(信用リスク集中回避のための投資制限を超えた場合の開示) 第 19 条の 2

委託会社は、運用規則第 17 条の 2 第 1 項に定めるエクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率が同条同項各号に掲げる区分ごとにそれぞれ 10%、合計で 20%(以下「基準比率」という。)を超えることとなった場合(中略)には、同条同項に定める調整が終了した後 3 ヶ月以内に、基準比率を超え、その後調整が終了した旨を当該委託会社のホームページその他の方法により開示するものとする。

※当資料は UBS アセット・マネジメントが一般社団法人投資信託協会規則に基づき開示を行うものであり、特定の投資信託の勧誘を目的とするものではありません。