

2023年2月14日

投資家の皆様

UBS アセット・マネジメント株式会社

UBS 環境ロング・ショート・ファンド（為替ヘッジあり）／（為替ヘッジなし）
の投資対象（外国投資信託）の償還予定について

拝啓 時下益々ご清祥のこととお慶び申し上げます。
平素より格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、弊社設定の「UBS 環境ロング・ショート・ファンド（為替ヘッジあり）／（為替ヘッジなし）」（以下、「当ファンド」とします）につきまして、主要投資対象である外国投資信託から近々償還を決議する旨の連絡がございました。当該外国投資信託の償還が確定いたしますと当ファンドも繰上償還せざるを得ない状況となり、この場合、約款の規定^(注1)に従い手続きを実施することとなりますので、あらかじめお知らせ申し上げます。

当ファンドの繰上償還の手続きにつきましては、当該外国投資信託からの償還決議に伴う正式な通知を受領いたしましたら改めてお知らせさせていただきます。

当ファンドの主要投資対象である外国投資信託「Environmental Long Short Japan Master Limited (Class A-JPY Hedged Shares)／(Class A-JPY Shares)」(以下「当外国投信」とします)の投資運用会社である UBS O' Connor LLC は、1月下旬に戦略的な見直しを行った際、当外国投信の運用戦略が、いかなる市場環境においてもリターンの獲得を目指すという投資目的を達成する有効な投資手段ではないと判断し、急速に変化する市場環境と株式ロング・ショート戦略の不安定な運用環境を考慮すると、当外国投信のポートフォリオのリスクを速やかにゼロにすることが当外国投信と投資家のために最善であると判断いたしました。その結果、当外国投信のポートフォリオの現金化を進め、2月7日ですべてのポジションを解消し現金化を完了しております。

なお、こうした状況を鑑み、当ファンドの2月以降の購入申込につきましては、受付けを停止することといたします。ただし、交付目論見書記載の換金申込^(注2)につきましては引き続き受付けをいたします。

本件につき大変ご迷惑をおかけいたしますが、ご理解のほど何卒よろしくお願い申し上げます。

敬具

記

(注1)

約款第39条（信託契約の解約）

（前略）

② 委託者は、この信託が主要投資対象とする外国籍の投資信託が存続しないこととなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

（後略）

(注2)

毎月の特定期日^{*1}に換金申込を受付けるものとします。

換金申込：当月の特定期日に係る換金の申込期限は、原則として特定日の5海外営業日前^{*2}までとし、当月の特定期日に係る申込については、当月の第1営業日から申込期限の日までの各営業日に行うものとします。

当月の指定された当該期間における各営業日の午後3時までに購入・換金申込が行われ、かつ当該申込に係る所定の事務手続きが完了したものを当月の申込分とします。

※1 特定日は、主要投資対象である指定外国投資信託における各月の最終営業日とします。なお、指定外国投資信託の営業日はロンドン証券取引所、東京証券取引所、ニューヨーク証券取引所およびロンドンの銀行、ニューヨークの銀行、ダブリンの銀行、日本の銀行、ケイマンの銀行が休業日でない日とします。

※2 海外営業日は、指定外国投資信託における営業日ベースとします。

以上