



2023年1月11日

投資家の皆様へ

UBS アセット・マネジメント株式会社

「UBS 米国成長株式リスク・コントロール・ファンド」の
月次報告書における訂正のお知らせ

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

「UBS 米国成長株式リスク・コントロール・ファンド」(以下「当ファンド」といいます。)の2022年11月末基準の月次報告書の記載内容の一部に誤りがございました。

投資家の皆様に深くお詫び申し上げますとともに、対象ファンド、誤記載の内容、正誤表、弊社における対応につきまして、下記にご報告申し上げます。

なお、この誤記載による当ファンドの基準価額や運用実績への影響はございません。

今後このような誤りが起きることのないよう、再発防止に努める所存でございますので、引き続きお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

敬具

記

<対象ファンド>

UBS 米国成長株式リスク・コントロール・ファンド

<誤記載の内容>

当ファンドの2022年11月末基準の月次報告書に記載の「ポートフォリオの状況 資産構成比」における「株価指数先物」の数値、「ご参考情報」における「月末の実質株式組入比率(目標値)」の図および「過去6ヵ月の推移」の表、また「市場概況と今後の見通し<運用状況>」のコメントにおきまして、以下の通り、誤りがございました。

<正誤表> 赤点線で囲んだ箇所または赤字の箇所が修正点になります。

ポートフォリオの状況 資産構成比			
正		誤	
株式等	78.6%	株式等	78.6%
その他 現金等	21.4%	その他 現金等	21.4%
合計	100.0%	合計	100.0%
(株価指数先物)	-30.1%	(株価指数先物)	30.1%
ご参考情報 月末の実質株式組入比率(目標値)			
正		誤	
(過去6ヵ月の推移)			
正		誤	
	100% 50% 0%		100% 50% 0%
2022年6月	- ○ ○	2022年6月	- ○ ○
2022年7月	- ○ ○	2022年7月	- ○ ○
2022年8月	- ○ ○	2022年8月	- ○ ○
2022年9月	- ○ ○	2022年9月	- ○ ○
2022年10月	- - ○	2022年10月	- - ○
2022年11月	- ○ ○	2022年11月	○ ○ ○
市場概況と今後の見通し <運用状況>			
正		誤	
<p>VIX 指数は低下しました。月の前半、米 CPI の下振れを受けて株価が反発、VIX 指数は低下しました。その後も、FRB 高官の発言などから米国の利上げペースの減速観測が広がる中で、VIX 指数は概ね低下傾向で推移しました。ファンドの実質株式組入比率(目標値)については、月初は0%でスタートしましたが、市場環境の落ち着きに伴い、月の前半に50%へと引き上げ、月末まで維持しました。</p>		<p>VIX 指数は低下しました。月の前半、米 CPI の下振れを受けて株価が反発、VIX 指数は低下しました。その後も、FRB 高官の発言などから米国の利上げペースの減速観測が広がる中で、VIX 指数は概ね低下傾向で推移しました。ファンドの実質株式組入比率(目標値)については、月初は0%でスタートしましたが、市場環境の落ち着きに伴い、月の前半に50%、月の半ばに100%へと引き上げ、月末時点では100%としました。</p>	

<弊社における対応>

弊社ホームページにて、2022年11月末基準の月次報告書につきましては、正しい内容に修正したものを改めて掲載させていただいております。

以上