

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和6年10月3日

【発行者名】 UBSマネジメント(ケイマン)リミテッド
(UBS Management (Cayman) Limited)

【代表者の役職氏名】 取締役 ブライアン・バークホルダー
(Director, Brian Burkholder)

【本店の所在の場所】 ケイマン諸島、KY1-1104、グランド・ケイマン、ジョージ・タウン、
ウグランド・ハウス、私書箱309
(P.O. Box 309, Ugland House, George Town, Grand Cayman, KY1-
1104, Cayman Islands)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 安達理
同 橋本雅行

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区大手町一丁目1番1号
大手町パークビルディング
アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業

【事務連絡者氏名】 弁護士 松本望
同 八重樫遼平
同 横山萌香

【連絡場所】 東京都千代田区大手町一丁目1番1号
大手町パークビルディング
アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業

【電話番号】 03(6775)1000

【届出の対象とした募集(売
出)外国投資信託受益証券に
係るファンドの名称】 UBSユニバーサル・トラスト(ケイマン) -
ピムコ・ショート・ターム・ストラテジー
(UBS Universal Trust (Cayman) - PIMCO Short Term Strategy)

【届出の対象とした募集(売
出)外国投資信託受益証券の
金額】 1,000億トルコリラ(約4,830億円)を上限とします。
(注)トルコリラの円貨換算は、2024年2月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対
顧客電信売買相場の仲値(1トルコリラ=4.83円)によります。以下、別段の
記載がない限り、米ドルの円貨表示はすべてこれによるものとします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2024年1月31日付で提出した有価証券届出書(2024年3月1日付有価証券届出書の訂正届出書および2024年4月30日付有価証券届出書の訂正届出書により訂正済。)について、2024年10月3日付で報酬代行会社および代行協会の異動がありましたので、これらに関する記載を訂正するため、またその他の記載事項のうち訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

別段の記載がない限り、訂正箇所を下線(下線の既に付してある見出しに関しては二重下線)で示します。

第一部 証券情報

(12) その他

<訂正前>

(前略)

(ロ) 引受等の概要

(中略)

管理会社は、クレディ・スイス証券株式会社(以下「代行協会」といいます。)をファンドに関して代行協会に指定しています。

(注1)「代行協会」とは、外国投資信託の受益証券の発行者と契約を締結し、受益証券1口当たり純資産価格の公表を行い、またファンドに関する目論見書、運用報告書その他の書類を受益証券を販売する日本の金融商品取引業者または登録金融機関に配布する等の業務を行う日本証券業協会(以下「JSDA」といいます。)の協会員をいいます。

(注2)代行協会については、UBS証券株式会社に異動することを予定しています。以下同じです。

(中略)

(二) 日本以外の地域における発行

日本以外の地域における販売は行われません。

海外において、当初1口当たり10.00トルコリラで受益証券の発行が行われました。

管理会社のグループ会社であり、ファンドの代行協会に指定されているクレディ・スイス証券株式会社は、シードマネーの拠出として、2019年7月29日に、ファンドの受益証券を、約100万米ドルに相当するトルコリラ建ての金額で取得しました。

<訂正後>

(前略)

(ロ) 引受等の概要

(中略)

管理会社は、UBS証券株式会社(以下「代行協会」といいます。)をファンドに関して代行協会に指定しています。

(注1)「代行協会」とは、外国投資信託の受益証券の発行者と契約を締結し、受益証券1口当たり純資産価格の公表を行い、またファンドに関する目論見書、運用報告書その他の書類を受益証券を販売する日本の金融商品取引業者または登録金融機関に配布する等の業務を行う日本証券業協会(以下「JSDA」といいます。)の協会員をいいます。

(注2)代行協会は、2024年10月3日付で、UBS証券株式会社に変更しました。以下同じです。

(中略)

(二) 日本以外の地域における発行

日本以外の地域における販売は行われません。

海外において、当初1口当たり10.00トルコリラで受益証券の発行が行われました。

第二部 ファンド情報

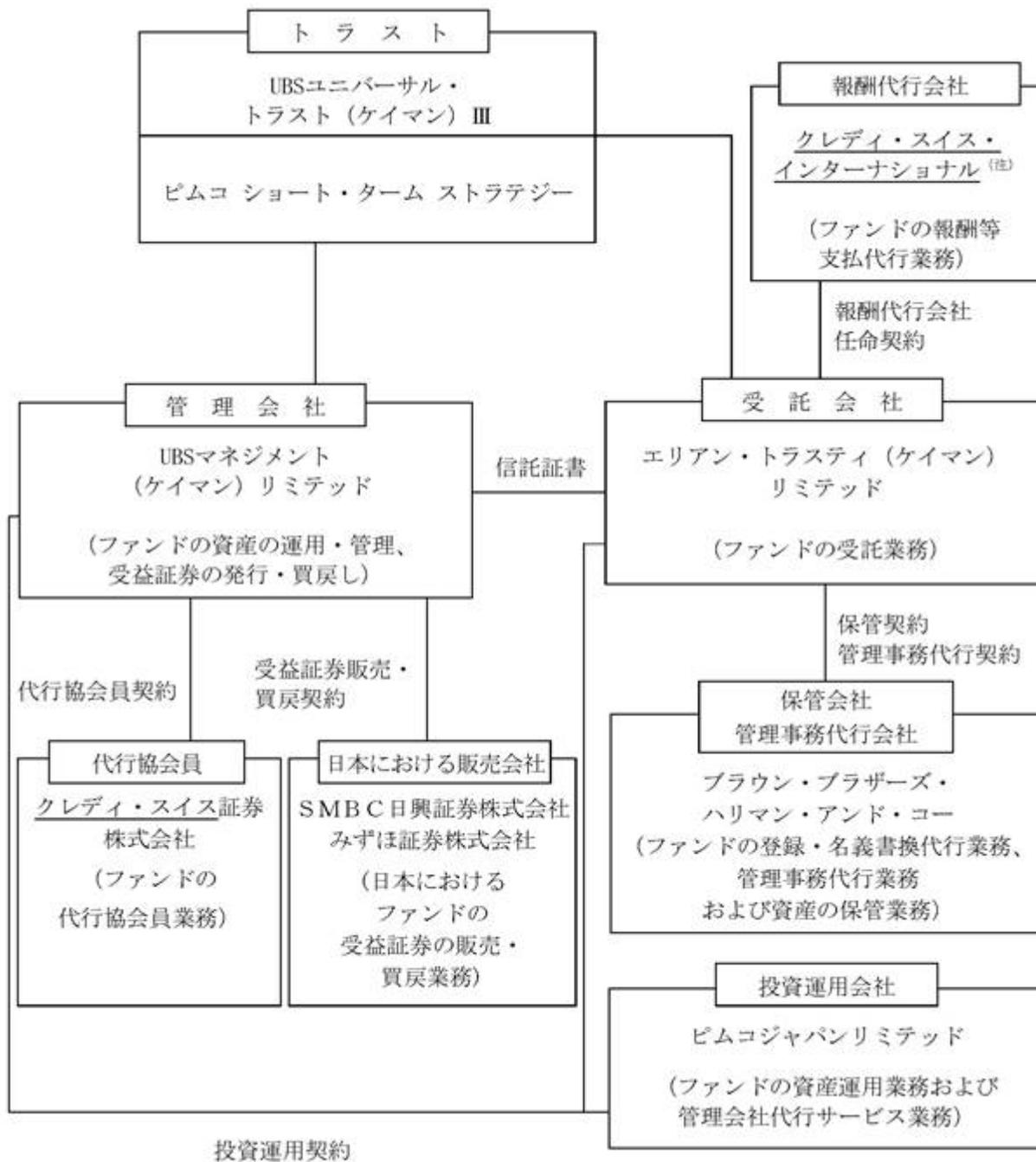
第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

ファンドの仕組み

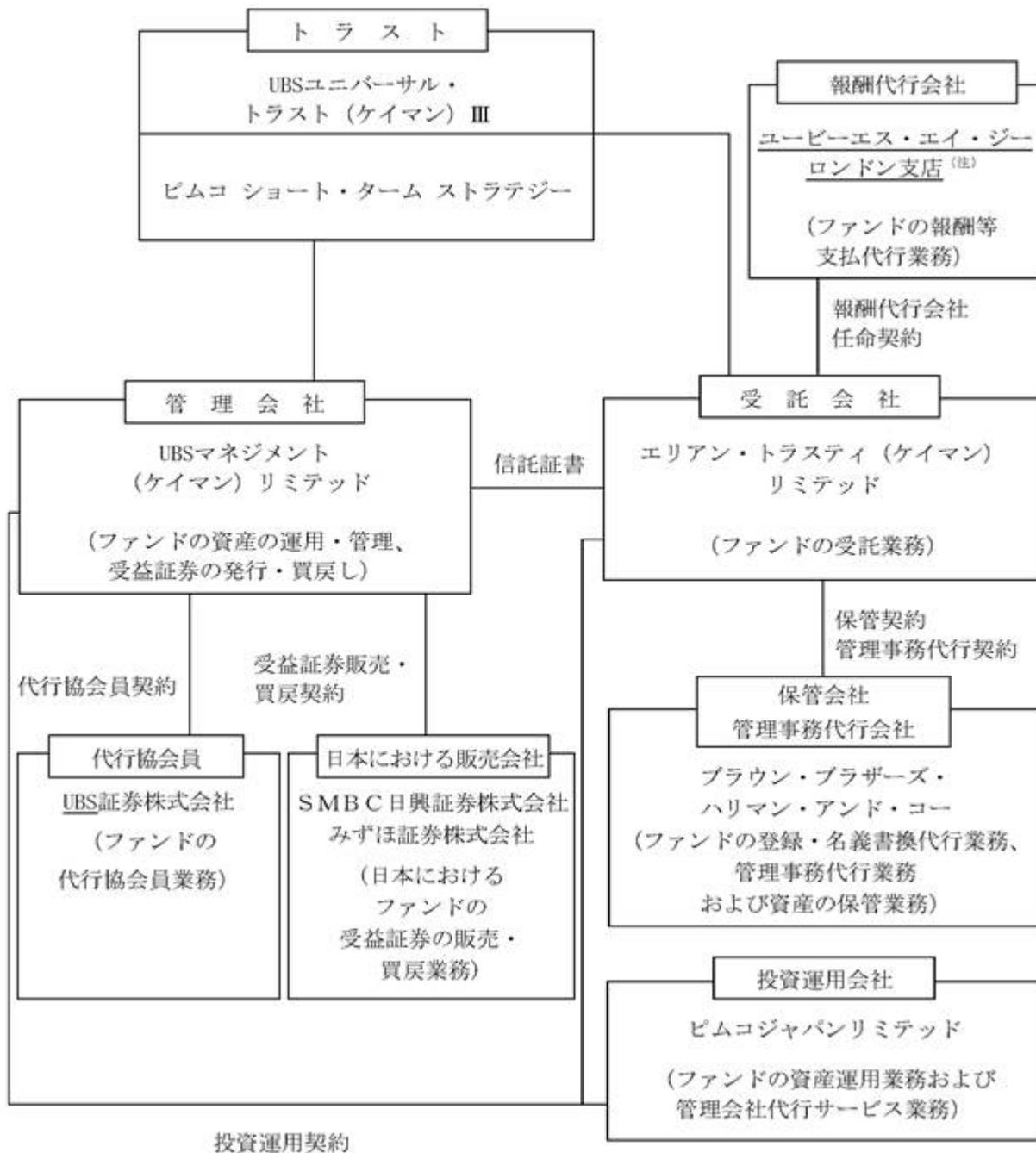
<訂正前>



(注) 報酬代行会社については、ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店に異動することを予定しています。以下同じです。

(後略)

<訂正後>



(注) 報酬代行会社は、2024年10月3日付で、ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店に変更しました。以下同じです。

(後略)

管理会社とファンドの関係法人の名称、ファンドの運営上の役割および契約等の概要

<訂正前>

名称	ファンド運営上の役割	契約等の概要
----	------------	--------

(中略)

クレディ・スイス証券株式会社	代行協会員	2019年7月10日付で管理会社との間で締結の代行協会員契約 ^(注3) において、代行協会員として提供する業務について規定しています。
----------------	-------	--

(中略)

クレディ・スイス・ インターナショナル (Credit Suisse International)	報酬代行会社	2019年7月12日付で受託会社との間で締結の報酬代行会社任命契約 ^(注5) において、ファンドに代わって行う運営経費の支払いについて規定しています。
--	--------	--

(後略)

<訂正後>

名称	ファンド運営上の役割	契約等の概要
----	------------	--------

(中略)

UBS証券株式会社	代行協会員	2024年10月3日付で管理会社との間で締結の代行協会員契約 ^(注3) において、代行協会員として提供する業務について規定しています。
-----------	-------	--

(中略)

ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店 (UBS AG, London Branch)	報酬代行会社	2024年10月3日頃、受託会社との間で締結の報酬代行会社任命契約 ^(注5) において、ファンドに代わって行う運営経費の支払いについて規定しています。
---	--------	--

(後略)

(5) 開示制度の概要

<訂正前>

(前略)

ファンドの監査人は、KY - 1106、グランド・ケイマン、ジョージ・タウン、シックス・クリケット・スクエアに所在するケーピーエムジーエルエルピー (KPMG LLC) です。

(後略)

<訂正後>

(前略)

ファンドの監査人は、KY - 1106、グランド・ケイマン、ジョージ・タウン、シックス・クリケット・スクエアに所在するケーピーエムジーエルエルピー (KPMG LLP) です。

(後略)

2 投資方針

(1) 投資方針

投資目的および投資方針

・投資目的

<訂正前>

(前略)

また、受託会社は、ファンドの受託者としての立場において、トルコリラクラス受益証券の勘定で、クレディ・スイス・インターナショナル^(注)(以下「通貨管理事務会社」といいます。)との間で通貨先渡取引を行います(下記「通貨先渡取引」の項目に詳述されます。)が、その想定元本は、受益者の米ドル建てのエクスポージャーをトルコリラ建てのエクスポージャーに変換する目的で、トルコリラクラス受益証券に帰属する受益証券1口当たり純資産価格に関連付けられます。

ファンドは、デリバティブ取引(差金決済されない通貨先渡取引を除きます。)またはその他類似する取引を行いません。

(注)通貨管理事務会社については、ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店に異動することを予定しています。以下同じです。

(中略)

■ファンドの目的

実質的に主として、米ドル建て投資適格債券に幅広く投資を行い、投資元本の保全と日々の流動性を確保しつつ、インカムの最大化を目指します。

■ファンドの特色

- 実質的に主として米ドル建て投資適格債券に投資を行い、デュレーションは原則1年以内とします。
 - ・ 投資運用会社は、主として米ドル建て投資適格債券に投資を行う投資対象ファンドの受益証券に投資することで、かかる投資成果を享受することを目指します。
 - ・ ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。
- 投資対象ファンドのポートフォリオの構築においては、金利リスク、信用リスクを抑制し、高い流動性と安定性の確保を追求します。
 - ・ 投資適格未満のハイイールド債への投資比率は投資対象ファンドの総資産額の10%を上限とします。
 - ・ 米ドル建て以外の通貨建ての債券への投資は投資対象ファンドの総資産額の10%を上限とします。
- 債券運用において専門性を有するPIMCOが実質的な運用を担当します。
 - ・ 投資対象ファンドの運用はグローバルに展開する世界最大級の債券運用残高を有する資産運用会社であるPIMCO(パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー)が行います。
- トルコリラクラスは、米ドル・トルコリラ間の為替変動リスクの抑制を目的として米ドル売りトルコリラ買いの為替取引を行い、トルコリラベースでの安定性の確保を目指します。

(注)円貨にてトルコリラ建てのトルコリラクラスを評価する際には、トルコリラ対日本円の為替相場の影響を受けます。

(注)クレディ・スイス・インターナショナルは、通貨管理事務会社として、受託会社との間で通貨先渡取引を行います。かかる通貨先渡取引は、通貨管理事務会社により管理されます。通貨管理事務会社については、ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店に異動することを予定しています。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(後略)

<訂正後>

(前略)

また、受託会社は、ファンドの受託者としての立場において、トルコリラクラス受益証券の勘定で、ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店^(注)(以下「通貨管理事務会社」といいます。)との間で通貨先渡取引を行います(下記「通貨先渡取引」の項目に詳述されます。)が、その想定元本は、受益者の米ドル建てのエクスポージャーをトルコリラ建てのエクスポージャーに変換する目的で、トルコリラクラス受益証券に帰属する受益証券1口当たり純資産価格に関連付けられます。

ファンドは、デリバティブ取引 (差金決済されない通貨先渡取引を除きます。) またはその他類似する取引を行いません。

(注) 通貨管理事務会社は、2024年10月3日付で、ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店に変更しました。以下同じです。

(中略)

■ ファンドの目的

実質的に主として、米ドル建て投資適格債券に幅広く投資を行い、投資元本の保全と日々の流動性を確保しつつ、インカムの最大化を目指します。

■ ファンドの特色

- 実質的に主として米ドル建て投資適格債券に投資を行い、デュレーションは原則1年以内とします。
 - 投資運用会社は、主として米ドル建て投資適格債券に投資を行う投資対象ファンドの受益証券に投資することで、かかる投資成果を享受することを目指します。
 - ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。
- 投資対象ファンドのポートフォリオの構築においては、金利リスク、信用リスクを抑制し、高い流動性と安定性の確保を追求します。
 - 投資適格未満のハイイールド債への投資比率は投資対象ファンドの総資産額の10%を上限とします。
 - 米ドル建て以外の通貨建ての債券への投資は投資対象ファンドの総資産額の10%を上限とします。
- 債券運用において専門性を有するPIMCOが実質的な運用を担当します。
 - 投資対象ファンドの運用はグローバルに展開する世界最大級の債券運用残高を有する資産運用会社であるPIMCO (パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー) が行います。
- トルコリラクラスは、米ドル・トルコリラ間の為替変動リスクの抑制を目的として米ドル売りトルコリラ買いの為替取引を行い、トルコリラベースでの安定性の確保を目指します。

(注) 円貨にてトルコリラ建てのトルコリラクラスを評価する際には、トルコリラ対日本円の為替相場の影響を受けます。

(注) ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店は、通貨管理事務会社として、受託会社との間で通貨先渡取引を行います。かかる通貨先渡取引は、通貨管理事務会社により管理されます。通貨管理事務会社は、2024年10月3日付で、ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店に変更しました。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(後略)

(3) 運用体制

< 訂正前 >

管理会社は、取締役会を随時開催し、投資運用の状況について報告を行うとともに、受託会社であるエリアン・トラスティ (ケイマン) リミテッド、管理事務代行会社および保管会社であるブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・コー、報酬代行会社であるクレディ・スイス・インターナショナルならびに投資運用会社であるピムコジャパンリミテッドの社内管理体制、内部管理手順等の定期的確認を行います。

(中略)

運用体制等は、2024年2月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >

管理会社は、取締役会を随時開催し、投資運用の状況について報告を行うとともに、受託会社であるエリアン・トラスティ (ケイマン) リミテッド、管理事務代行会社および保管会社であるブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・コー、報酬代行会社であるユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店ならびに投資運用会社であるピムコジャパンリミテッドの社内管理体制、内部管理手順等の定期的確認を行います。

(中略)

運用体制等は、2024年10月3日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

第三部 特別情報

第1 管理会社の概況

1 管理会社の概況

(2) 会社の機構

<訂正前>

管理会社の定款によれば、管理会社の業務は10名以上(代理取締役は除きます。)で構成される取締役会によって管理されます。取締役の株式保有資格は総会において管理会社によりかかる決定がなされるまで要求されません。管理会社は通常の決議により取締役を選任でき、同様に取締役を解任し、代わりに他の者を指名できます。取締役は、管理会社の定款に定められた最大数を条件として、いつでも随時何人をも取締役に指名する権限を有します。

(中略)

株主総会が、適式に成立した場合には、全株主を代表します。株主総会は、管理会社に代わって活動を行い、かつ、承認し、ならびに議題を提案する幅広い権限を有します。

(後略)

<訂正後>

管理会社の定款によれば、管理会社の業務は10名以下(代理取締役は除きます。)で構成される取締役会によって管理されます。取締役の株式保有資格は総会において管理会社によりかかる決定がなされるまで要求されません。管理会社は通常の決議により取締役を選任でき、同様に取締役を解任し、代わりに他の者を指名できます。取締役は、管理会社の定款に定められた最大数を条件として、いつでも随時何人をも取締役に指名する権限を有します。

(中略)

株主総会が、適式に成立した場合には、全株主を代表します。株主総会は、管理会社に代わって議案に記載された全ての活動を行い、かつ、承認する幅広い権限を有します。

(後略)

第2 その他の関係法人の概況

1 名称、資本金の額及び事業の内容

<訂正前>

(前略)

(3) クレディ・スイス証券株式会社(「代行協会員」)

(イ) 資本金の額

2023年11月末日現在 781億円

(ロ) 事業の内容

クレディ・スイス証券株式会社は、UBSの日本における拠点として、証券・投資銀行業務を展開しています。日本での長い経験とグローバルな実績をもとに、株式、債券、コーポレート・アドバイザー、ファイナンス、プライベート・エクイティ、オルタナティブなど、多岐にわたるサービスを提供しています。

(中略)

(6) クレディ・スイス・インターナショナル(Credit Suisse International)(「報酬代行会社」)

(イ) 資本金の額

2023年11月末日現在の払込済株式資本は、113億6,600万米ドル(約1兆6,715億9,762万円)です。

(ロ) 事業の内容

英国法の下で設立された英国に住所を有する銀行であるクレディ・スイス・インターナショナル(以下「C S I」といいます。)は1990年5月9日に、1985年会社法に従ってイングランドおよびウェールズで設立されました(登記番号2500199)。1990年7月6日には、「クレディ・スイス・ファイナンシャル・プロダクツ」という社名の無限責任会社に登記が変更され、2000年3月27日に「クレディ・スイス・ファースト・ポストン・インターナショナル」に、2006年1月16日に「クレディ・スイス・インターナショナル」に社名が変更されました。

C S Iは、ブルーデンス規制機構(以下「P R A」といいます。)の認可を受けており、英国金融行為監督機構およびP R Aによる規制を受けています。

C S Iは、スイス法に基づき株式会社(Aktiengesellschaft)として設立された持株会社であるUBSグループ・エイ・ジーの間接完全子会社です。C S Iの登記上の本店はロンドンにあり、ワン・カポット・スクウェア、ロンドン、E14、4QJに位置し、電話番号は+44(0)20 7888 8888です。C S Iの取引主体識別子(L E I)は、E58DKGMJYJYJLN8C3868です。C S Iは無限責任会社であり、このため同社株主は、同社の清算時にその資産に不足分がある場合、それに対応するための連帯無限責任を負います。同社資産に不足分がある場合にそれに対応するための株主の連帯無限責任は、同社の清算時においてのみ適用します。よって、その清算までは、有価証券の保有者は同社資産に対してのみ償還請求権を有し、その株主の資産については当該請求権を有しません。

C S Iは1990年7月16日に事業を開始しました。同社の主たる事業は銀行業(金利、外国為替、株式、商品、および信用に連動するデリバティブ商品の取引を含みます。)です。同社の主たる目的は、包括的な資金およびリスク管理のデリバティブ商品サービスを提供することです。同社はあらゆる種類のデリバティブ商品を提供することにより世界中のデリバティブ市場で大きな存在感を確立し、顧客ニーズならびに基本となる市場の変化に対応した新商品開発を継続しています。その事業は、クレディ・スイス・エイ・ジー(Credit Suisse AG)のグローバルマーケット部門、インベストメント・バンキング部門およびキャピタルマーケット部門の一環として行われています。

(後略)

<訂正後>

(前略)

(3) UBS証券株式会社(「代行協会員」)

(イ) 資本金の額

2024年7月末日現在 347億円

(ロ) 事業の内容

代行協会員は日本の証券会社であり、ユービーエス・エイ・ジーの完全子会社です。

代行協会員は、金融商品取引法に基づく登録を受けた金融商品取引業者です。管理会社は、日本法、特にJSDAが採用する外国証券の取引に関する規則を遵守するため、代行協会員を任命しています。代行協会員は、代行協会員契約に基づき、受託証券に関する日本語の目論見書の日本における販売会社への送付、受益証券1口当たり純資産価格の公表ならびに日本法および/またはJSDAの規則により要請される日本におけるファンドの財務書類の備置について責任を負います。

(ハ) 異動の理由

代行協会員の属するクレディ・スイス・グループのUBSグループとの統合に伴い、代行協会員を変更するため。

(中略)

(6) ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店(UBS AG, London Branch)(「報酬代行会社」)

(イ) 資本金の額

2024年7月末日現在 386百万米ドル(約588億4,184万円)です。

(ロ) 事業の内容

ユービーエス・エイ・ジーは1978年2月28日にエスピーシー・エイ・ジーという名称により存続期間を無期限として設立され、同日にカントン・バーゼル市の商業登記簿に登録されました。1997年12月8日、同社は商号をユービーエス・エイ・ジーに変更しました。同社は、1998年6月29日にスイス・ユニオン銀行(1862年設立)とスイス銀行コーポレイション(1872年設立)が合併して現在の形となりました。ユービーエス・エイ・ジーは、カントン・チューリッヒおよびカントン・バーゼル市の商業登記簿に登録されています。登記番号は、CHE-101.329.561です。

ユービーエス・エイ・ジーは、スイスで設立され、スイスに本拠地を置き、スイス法に基づき株式会社(Aktiengesellschaft)として事業を行っています。また、関連するスイス法令上のコーポレート・ガバナンス要件をすべて遵守しています。ユービーエス・エイ・ジーは、ニューヨーク証券取引所(以下「NYSE」といいます。)に上場している債券を有する外国民間発行体として、外国民間発行体に適用されるNYSEのコーポレート・ガバナンス基準も遵守しています。

ユービーエス・エイ・ジーは、UBSグループの持株会社であるUBSグループ・エイ・ジーが100%所有しています。ユービーエス・エイ・ジーは、4つの事業部門(グローバル・ウェルス・マネジメント、パーソナル&コーポレート・バンキング、アセット・マネジメントおよびインベストメント・バンク)およびグループ・ファンクションを有し、グループとして事業を行っています。ユービーエス・エイ・ジーの目的は銀行の運営です。その業務範囲は、スイス国内外におけるあらゆる種類の銀行業務、金融業務、アドバイザリー業務、トレーディング業務およびサービス業務に及びます。ユービーエス・エイ・ジーは、スイス国内外において、支店および駐在員事務所ならびに銀行、金融会社およびその他のあらゆる種類の企業を設立し、これらの企業の持分を保有し、その管理を行うことができます。ユービーエス・エイ・ジーは、スイス国内外において不動産および建物に関する権利の取得、抵当権設定および売却を行うことができます。ユービーエス・エイ・ジーは、資本市場で資金の借入れおよび投資を行うことができます。ユービーエス・エイ・ジーは、グループ親会社であるUBSグループ・エイ・ジーが支配する企業グループに属しています。同社は、グループ親会社または他のグ

グループ会社の利益を促進する場合があります。また、グループ会社のために貸付、保証その他の種類の融資や担保を提供する場合があります。

ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店は、1998年に設立され、ユービーエス・エイ・ジーの支店です。設立番号BR004507でイングランドおよびウェールズにおいて登録されており、その登記上の事務所は、EC2M、2QS、英国、ロンドン、ブロードゲート5です。ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店は、スイス金融市場監督機関による認可および規制を受けています。また、英国プルーデンス規制機構の認可を受けており、英国金融行為監督機構による規制およびプルーデンス規制機構による一定の規制を受けています。

(八) 異動の理由

報酬代行会社の属するクレディ・スイス・グループのUBSグループとの統合に伴い、報酬代行会社を変更するため。

(後略)

2 関係業務の概要

<訂正前>

(前略)

(3) クレディ・スイス証券株式会社

日本における代行協会員業務を行います。

(中略)

(6) クレディ・スイス・インターナショナル(Credit Suisse International)

報酬代行会社任命契約に基づき、報酬等支払代行業務を行います。

(後略)

<訂正後>

(前略)

(3) UBS証券株式会社

日本における代行協会員業務を行います。

(中略)

(6) ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店(UBS AG, London Branch)

報酬代行会社任命契約に基づき、報酬等支払代行業務を行います。

(後略)

3 資本関係

<訂正前>

UBS マネジメント(ケイマン) リミテッド(管理会社)、クレディ・スイス・インターナショナル(報酬代行会社)およびクレディ・スイス証券株式会社(代行協会員)は、いずれもUBSグループ・エイ・ジーを最終親会社とするグループ会社です。

<訂正後>

UBS マネジメント(ケイマン) リミテッド(管理会社)、UBS証券株式会社(代行協会員) および ユービーエス・エイ・ジー ロンドン支店(報酬代行会社) は、いずれもUBSグループ・エイ・ジーを最終親会社とするグループ会社です。