

2011年11月17日

スーパーファンド・グリーン・ジャパン及びスーパーファンド・グリーン・ゴールド・ジャパンの受益者の皆様へ

スーパーファンド・グリーン・ジャパン及びスーパーファンド・グリーン・ゴールド・ジャパン(以下「当ファンド」と表記)に関する現状をお知らせ致します。

当ファンドの管理会社であるスーパーファンド・ジャパン・トレーディング(ケイマン)リミテッド及び受託会社であるUBSファンド・サービスズ(ケイマン)リミテッドは、米証券大手MFグローバル(先物取引等の金融デリバティブ決済業務を行うブローカー)に対する破産手続きが2011年10月31日に開始されて以降、マスターファンドの投資顧問会社であるスーパーファンド・キャピタル・マネジメント・インク、法律顧問及び監査法人と協議した結果、MFグローバルのすべての顧客口座が現在、米規制当局によって凍結されており現金化できないこと等、現下の状況に鑑み、当ファンドのマスターファンド(スーパーファンド・グリーン SPC及びスーパーファンド・グリーン・ゴールド SPC)の2011年10月31日付け純資産価額の計算において、MFグローバルに保管されている資産価額をゼロと評価することを決定いたしました。したがって、マスターファンドに全資産を投資する当ファンドの2011年10月31日付け純資産価額は、当該評価の影響を受けることとなります。

当ファンドのサブファンドの資産総額のうち、MFグローバルに現在保管されている資産価額の割合は下記の通りであり、これらは現在のところ現金化できません。

スーパーファンド・グリーン・ジャパン サブファンド A	4.27%
スーパーファンド・グリーン・ジャパン サブファンド B	6.41%
スーパーファンド・グリーン・ジャパン サブファンド C	8.54%
スーパーファンド・グリーン・ゴールド・ジャパン サブファンド A	4.14%
スーパーファンド・グリーン・ゴールド・ジャパン サブファンド B	6.21%

2011年10月31日現在の当ファンドの受益者の皆様([a] 2011年10月31日現在、スーパーファンド・グリーン・ジャパンの第1シリーズを保有されている受益者の皆様及び2011年11月1日付のシリーズ統合によりスーパーファンド・グリーン・ジャパンの第1シリーズを保有することになる受益者の皆様、[b] 2011年10月31日現在、スーパーファンド・グリーン・ゴールド・ジャパンの第1シリーズを保有されている受益者の皆様及び2011年12月1日付のシリーズ統合によりスーパーファンド・グリーン・ゴールド・ジャパンの第1シリーズを保有することになる受益者の皆様;以下「第1シリーズの受益者の皆様」と表記)につきまして、買戻しを行われる第1シリーズの受益者の皆様はMFグローバルから随時返還される予定の資産に対する持分を保有するため、当該資産の全部又は一部がMFグローバルから返還され当ファンドの純資産価額が再評価により増額した時点で、販売会社を経由してその増額分に比例する持分を現金で受領する権利を持つこととなります。買戻しをされない第1シリーズの受益者の皆様につきましては、純資産価額の増額という形で、MFグローバルから随時返還される資産の評価額に相当する利益を享受する権利を持つこととなります。

第1シリーズの受益者の皆様以外の当ファンドへの投資家の皆様(2011年11月1日以降に当ファンドの受益者になられる投資家の皆様)には、上記の権利はございません。

当ファンドの受託会社は受益者間の公平を期すため、当ファンドに対して2011年10月31日付けの買戻し請求を提出した受益者の皆様につきまして、2011年11月22日(火)までに販売会社又は販売取次会社に申し出ることにより、当該買戻し請求を取り消しできるように配慮いたしました。この申し出がない場合、買戻し請求はそのまま10月31日付けで処理されます。

現在、当ファンドのマスターファンドの取引は他の先物ブローカーを通じて正常に遂行されており、今後、当ファンドの純資産価額の計算、及び購入申込みと買戻し請求は継続されます。当ファンドの管理会社及び受託会社は MF グローバルの状況を継続的に監視し、MF グローバルに保管されている資産の返還のために適切な措置を実施するとともに、受益者の皆様へ最新情報を提供するため最善の努力をいたします。

以上

【参考情報】

MF グローバルの経営破綻について

2011年10月31日、米規制当局は、MF グローバルの顧客資産の不足が報告された直後に、同社に対して破産手続きを開始しました。現在、MF グローバルの顧客口座から顧客資産が不正に流用されたかどうかについて、米国証券取引委員会 (SEC)、米国商品先物取引委員会 (CFTC)、米国連邦捜査局 (FBI) が調査を実施しています。

スーパーファンドは、リスク管理の一環として、マネージドフューチャーズ・ファンドの取引上、4社のブローカーを利用しています。その中の1社である MF グローバルは、2011年10月31日時点で、スーパーファンド全体の運用資産総額12億米ドル超の約5.6%を保有していました。

MF グローバルのすべての顧客口座は現在、米規制当局によって凍結されており、現金化が禁止されています。米規制当局は、MF グローバルの顧客資金が不正に流用されていた可能性、またその場合の流用額について調査を進めています。顧客口座に不足がある場合、その原因は MF グローバルによる不正流用又は詐欺行為にあります。

米国証券会社の顧客資産は、(米国市場での取引において) 分別口座で管理されること、また(米国以外の口座の取引において) 保全口座にて管理されることが米国の法律により定められています。米規制当局は、MF グローバルの分別口座で11.6%(約6.3億米ドル)の不足が見込まれると発表しました。現時点では、顧客の保全口座での不足は発表されていません。これらの調査結果によると、スーパーファンドのマネージドフューチャーズ・ファンド全体の資産のうち、800万米ドル弱が影響を受けることとなります。なお、これらは確定値ではなく、米規制当局の調査結果次第で変わる可能性があります。

現時点で、スーパーファンドのマネージドフューチャーズ・ファンドのすべての先物ポジションについて、他のブローカーへの移転が完了しました。したがって、スーパーファンドのファンド運用に関しては、MF グローバルを除く3社のブローカー口座を通じて、継続した取引が問題なく遂行されています。

MF グローバルの破綻による実際の影響は現在、正確には確定できません。スーパーファンドにとってこれは非常に遺憾な状況であり、お客様にご不便、ご迷惑をお掛けすることをお大変申し訳なく存じております。投資家の皆様方には、当事案に関する情報を迅速にご提供することをお約束いたします。

【免責事項】

本文書はスーパーファンド・ジャパン・トレーディング(ケイマン)リミテッドからの情報に基づき、スーパーファンド証券株式会社が作成したものです。本文書内のすべての予想値等は11月16日時点での情報に基づくものであり、変更になる可能性があります。