

【表紙】

【提出書類】 臨時報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和４年９月12日

【ファンド名】 インダストリア
(Industria)

【発行者名】 アリアンツ・グローバル・インベスターズ・ゲーエムベーハー
(Allianz Global Investors GmbH)

【代表者の役職氏名】 業務執行役員 インゴ・マイネルト
(Ingo Mainert)
業務執行役員 ペトラ・トラウツショルド
(Petra Trautschold)
業務執行役員 ビルテ・トレクナー
(Birte Trenkner)
業務執行役員 トマス・シンドラー
(Thomas Schindler)
業務執行役員 アレクサンドラ・アウアー
(Alexandra Auer)
業務執行役員 ルドヴィク・ロンバード
(Ludovic Lombard)

【本店の所在の場所】 ドイツ連邦共和国 60323 フランクフルト市 ボッケンハイマー ラン
トシュトラッセ 42-44
(Bockenheimer LandstaBe 42-44, 60323 Frankfurt, The
FederalRepublic of Germany)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目 6 番 1 号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目 6 番 1 号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03(6212)8316

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

1【提出理由】

インダストリア(Industria)(以下「ファンド」といいます。)に関して、以下のとおりファンドの投資方針および投資制限の変更がありましたので、金融商品取引法第24条の5第4項ならびに特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令第29条第2項第3号の規定に基づき本臨時報告書を提出するものです。

2【報告内容】

(イ) 変更の内容についての概要

ファンドの投資方針および投資制限が、以下のとおり変更されました。

(注) 変更箇所には下線を付しています。

投資方針

(前略)

ファンドの運用アプローチ

(中略)

ファンドの受益証券クラスが特定の通貨に対してヘッジされる場合、ファンドおよび/または当該受益証券クラスのそれぞれのベンチマーク指数もまた、当該通貨に対してヘッジされる。ファンドおよび/または当該受益証券クラスのベンチマーク指数が金利である場合、ファンドのヘッジされる受益証券クラスは、ヘッジされる通貨に対して適切な期間の適切な代替的な金利を用いることがある。

ファンド・マネジャーは、デュー・デリジェンス・プロセスの一環として、投資のリターンに多大な悪影響を及ぼす可能性があるすべての関連する持続可能性リスクを含む、投資判断におけるすべての関連する金融リスクを検討し、これらを継続的に評価する。持続可能性リスクの評価では、現金および預金、派生商品ならびに信用格付のない投資対象を評価の対象とはしていない。持続可能性リスクは、以下のとおりに要約される。

- ・全世界に関連する大規模な持続可能性リスク（例えば、地球温暖化および気候変動）
- ・特定のセクターにエクスポージャーを有するファンドに関連する持続可能なセクターに関するリスク（例えば、石油・ガスセクターの回復不能な資産に関するリスク）
- ・法人発行体および政府発行体にエクスポージャーを有するファンドに関連する個々の法人発行体および政府発行体のレベルに特有の持続可能性リスク（例えば、気候変動のリスク）
- ・持続可能な大規模リスク、持続可能なセクターに関するリスクおよび特に投資先の持続可能な発行体に関するポートフォリオのエクスポージャーから派生した、ポートフォリオレベルの持続可能な投資に関するリスク

持続可能性リスクは、社外の持続可能性に関する調査データならびに／または社内の調査および分析を用いて評価される。社外および社内の調査は、いずれも、持続可能性に関連する発行体の証券への投資における潜在的金融リスクの特定を目的とする。発行体は、法人発行体、ソブリン発行体またはサブソブリン機関の発行体である場合がある。詳細は、<https://www.allianzgi.com/en/our-firm/esg>において確認可能なリスク管理方針声明に記載されている。

管理会社は、ネット・ゼロ・アセット・マネージャー・イニシアティブに加盟し、エクスポージャーを含むスチュワードシップを通じて、いわゆるPAI指標を考慮するが、これらは、いずれも、会社としての潜在的な悪影響を緩和する目的に関連するものである。

PAI指標は、個々の投資戦略（概要については、下記を参照のこと。）を適用する際にファンド・マネージャーによって考慮される、様々な主要な悪影響の指標である。PAI指標には、とりわけ、温室効果ガスの排出量、生物多様性、水、廃棄物ならびに法人発行体に関する社会的検討事項および労働に関する検討事項ならびに該当する場合は、政府発行証券への投資に関する指標が含まれる。PAI指標は、適用される個々の投資戦略（概要については、下記を参照のこと。）の一環として記載される直接除外条項（最小限の除外に関する基準）によって、ファンド・マネージャーによる投資のプロセスを考慮している。

管理会社は、ネット・ゼロ・アセット・マネージャー・イニシアティブに対する自らのコミットメントに基づき、その管理下にあるすべての資産について、2050年までに正味排出量ゼロを達成する目標とともに、脱炭素目標を達成するために協働する資産保有者のクライアントと協力し、温室効果ガス排出量の削減に努める。管理会社は、この目標とともに、2050年までに正味排出量ゼロを達成することに取り組むにあたり、管理される資産の割合に関する中間目標を設定する。

ファンドの経営陣は、そのスチュワードシップ活動の一環として、保有銘柄による主要な悪影響および直接保有証券に関する議決権の代理行使について意見を述べる。特に、ファンド・マネージャーは、その議決権の代理行使に関するガイドラインを通じて、すべての取締役会および経営チームが少なくとも30%のジェンダー・レプリゼンテーションを目指すよう奨励する。

更なる情報（追加の詳細情報を含む。）は、管理会社のグローバル・コーポレートガバナンス・ガイドラインに記載されており、ウェブサイト（<https://allianzglobalinvestors.com>）において確認することができる。

UCITSファンドのファンドの経営陣は、個々の投資戦略（概要については、下記を参照のこと。）を適用するため、温室効果ガスの排出量、生物多様性、水、廃棄物ならびに法人発行体に関する社会的検討事項および労働に関する検討事項ならびに該当する場合は、国債への投資に対して適用される指標とともに、社内の持続可能な対象ファンドの取得にも関連して適用される、個々の投資戦略（概要については、下記を参照のこと。）について記載した除外基準に関連するいわゆる「PAI指標」（概要については、上記を参照のこと。）を考慮する。PAI指標は、具体的な投資戦略において定められるファンド・マネージャーの投資プロセスの一環として、除外基準によって考慮される。

PAI指標に関して要求されるデータの網羅範囲は、多様な要素により構成されている。データ不足により、ファンド・マネジャーは、投資対象の会社におけるジェンダーごとの未調整の賃金格差を依然として評価することができない。さらに、生物多様性、水および廃棄物に関するデータの網羅範囲は狭く、対応するPAI指標は、国連グローバル・コンパクトの一部である深刻な論争中の問題から除外されるものと考えられる。ファンド・マネジャーは、このように、データの網羅範囲が狭いPAI指標のデータの網羅範囲を拡大するよう尽力している。ファンド・マネジャーは、データの入手可能性が、当該データの評価を投資プロセスに組み込むことができるほど十分に高まったかを定期的に確認する。

管理会社は、ファンドのために以下の資産を取得することができる。

(後略)

投資制限

ファンドは、以下の制限に従って投資活動を行うことができる。

(中略)

・投資約款により課される投資制限

(中略)

同一の発行体の証券および短期金融商品の取得を目的とする場合、ファンドの資産総額の10%を超過して利用してはならないものとし、また、かかる発行体の証券および短期金融証券の総価値は、ファンドの資産総額の40%を超過してはならない。

(口) 変更の年月日

2022年 8 月31日

添付書類

- 1．在職証明
- 2．委任状