

【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3年10月27日
【ファンド名】	UBS（Lux）エクイティ・ファンド （UBS（Lux）Equity Fund）
【発行者名】	UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ （UBS Fund Management（Luxembourg）S.A.）
【代表者の役職氏名】	メンバー・オブ・ザ・エグゼクティブ・ボード ヴァレリー・ベルナール （Valérie Bernard） メンバー・オブ・ザ・エグゼクティブ・ボード ジェフリー・ラヘイ （Geoffrey Lahaye）
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグL-1855、 J.F.ケネディ通り33A番 （33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg）
【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 弁護士 大西 信治
【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】

UBS（Lux）エクイティ・ファンド（UBS（Lux）Equity Fund）（以下「ファンド」といいます。）のサブ・ファンドであるUBS（Lux）エクイティ・ファンド－ユーロ・カントリーズ・オポチュニティ（ユーロ）（UBS（Lux）Equity Fund－Euro Countries Opportunity（EUR））（以下「サブ・ファンド」といいます。）の名称が変更され、投資方針が以下のとおり変更されましたので、ファンドの管理会社であるUBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ（UBS Fund Management（Luxembourg）S.A.）は、金融商品取引法第24条の5第4項および特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令第29条2項3号の規定に基づき本臨時報告書を提出するものであります。

2【報告内容】

（イ）変更の内容についての概要

サブ・ファンドの名称は、UBS（Lux）エクイティ・ファンド－ユーロ・カントリーズ・オポチュニティ・サステナブル（ユーロ）（UBS（Lux）Equity Fund－Euro Countries Opportunity Sustainable（EUR））に変更され、投資方針は以下のとおり変更されました。

（注）下線部___は変更箇所を示します。

UBSアセット・マネジメントは、本サブ・ファンドをサステナビリティ・フォーカス・ファンドに分類している。本サブ・ファンドは、環境的および社会的特性を促進し、金融サービスセクターにおけるサステナビリティ関連開示に関する規則（EU）2019／2088第8条（1）に該当する。サブ・ファンドは、その資産の少なくとも70%を欧州経済通貨同盟（EMU）の加盟国に所在する、またはEMU加盟国で活発な活動を行っている企業の株式およびその他持分に投資する。EMUに属する国々は、EMUに参加しているため、その国の通貨がユーロである。

当該投資の範囲で、本サブ・ファンドは、（オープン・エンド型投資信託であり、一般投資方針に定められる投資制限（純資産の10%）に従う）ヨーロッパの小型株および／またはヨーロッパの中型株に直接的もしくは間接的に投資を行うこともできる。投資制限の「5証券および短期金融商品を裏付資産とする特別の技法および手段」に従い、サブ・ファンドは、インデックス先物を利用して市場へのエクスポージャーを増減させることができる。

ポートフォリオ・マネージャーは、強力な環境および社会パフォーマンスの特性または強力なサステナビリティ・プロファイルを有する投資ユニバースについて企業を特定するために、UBS ESGコンセンサススコアを用いる。かかるUBS ESGコンセンサススコアは、内部および認められた外部プロバイダーからのESGスコアデータの標準加重平均である。プロバイダー1社からのESGスコアデータに依拠する場合よりも、コンセンサススコアのアプローチは、サステナビリティ・プロファイルの質の妥当性を向上させる。UBS ESGコンセンサススコアは、環境、社会およびガバナンス（ESG）に関して、関連する企業のパフォーマンス等持続可能性要因を評価する。かかるESG特性は、企業の業務の主要分野およびESGリスク管理の有効性に関連する。環境および社会要因には、（とりわけ、）環境フットプリントおよび経営効率、環境リスク管理、気候変動、天然資源の使用、汚染・廃棄物管理、雇用基準やサプライチェーンの監理、人的資本、ボード・ダイバーシティ、職業安全衛生、製品安全性ならびに贈収賄および腐敗防止ガイドラインが含まれる可能性がある。

サブ・ファンドの各投資対象は、UBS ESGコンセンサススコア（1～10の基準で、10が最高のサステナビリティ・プロファイル）を有する。サブ・ファンドのサステナビリティ・プロファイルは、加重平均されたUBS ESGコンセンサススコアを用いて測定される。サブ・ファンドは、そのベンチマークのサステナビリティを上回るか、またはUBS ESGコンセンサススコアの7から10（強力なサステナビリティ・プロファイルを示す。）を有するサステナビリティ・プロファイルを維

持する。算定には現金および無格付投資商品は考慮されない。サブ・ファンドのサステナビリティ・プロフィールは、そのベンチマークのプロファイルに照らして測定され、その結果は、年1回以上、関連する月次のプロファイルから計算され、年次報告書において公表される。サブ・ファンドは、環境的および社会的特性ならびにガバナンス特性を促進する。サブ・ファンドは、E S Gリスクが高いまたは重大なサステナビリティ・プロファイルを有する企業を除外する。また、排除方針のほかに、サブ・ファンドは、タバコの生産、風俗、石炭または石炭火力発電所由来のエネルギーにより主な収益を得る企業への直接的な投資を行わない。サブ・ファンドは、パフォーマンスおよびE S G特性を監視するため、またE S Gおよび投資リスク管理ならびにポートフォリオ構築の目的において、ベンチマークであるM S C I E M U（正味配当金再投資）を用いる。ベンチマークは、E S G特性を促進させるよう策定されたものではない。投資戦略および監視プロセスは、商品の環境的または社会的特性が確実に考慮されるようにする。ポートフォリオ・マネージャーは、ポートフォリオを構築する際に、自らの裁量権を行使することができ、銘柄または組入比率の点においてベンチマークに縛られない。つまり、サブ・ファンドの投資パフォーマンスは、ベンチマークから乖離することがある。名称に「ヘッジ」を含む受益証券クラスに関しては、ベンチマークの為替ヘッジバージョン（利用可能な場合）が用いられる。

基準通貨は、ユーロである。

典型的な投資家の特性

アクティブ運用されるサブ・ファンドは、ユーロ圏のヨーロッパの企業の株式ポートフォリオおよび環境および／または社会的特性を促進するサブ・ファンドに投資することを望む投資家に適している。投資家は、株式に固有のリスクを負う覚悟を持つべきである。

（中略）

証券金融取引のエクスポージャー

サブ・ファンドのトータル・リターン・スワップ、レポ契約／リバースレポ契約および証券貸付取引のエクスポージャー（いずれの場合も、純資産価額に対する割合）は、以下のとおりである。

サブ・ファンド	トータル・リターン・スワップ		レポ契約／リバースレポ契約		証券貸付契約	
	予想値	最大値	予想値	最大値	予想値	最大値
UBS（Lux）エクイティ・ファンド －ユーロ・カントリーズ・オポチュニ ティ・サステナブル（ユーロ）	0%	15%	0%	25%	0%－40%	50%

（後略）

（口）当該変更の年月日

2021年10月27日