

【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4年1月31日

【発行者名】 UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ
(UBS (Lux) Key Selection SICAV)

【代表者の役職氏名】 チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
ロバート・シュティンガー (Robert Süttinger)
メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
トーマス・ローズ (Thomas Rose)

【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
(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
弁護士 大 西 信 治

【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

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券に係る外国投資法人の名称】
UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ
- グローバル・アロケーション(米ドル)
- グローバル・アロケーション(ユーロ)
- ダイナミック・アルファ(米ドル)
(UBS (Lux) Key Selection SICAV
- Global Allocation (USD)
- Global Allocation (EUR)
- Dynamic Alpha (USD))

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券の形態及び金額】
記名式無額面投資証券
グローバル・アロケーション(米ドル)
クラスP - a c c 投資証券
円建クラスP - a c c 投資証券
グローバル・アロケーション(ユーロ)
クラスP - a c c 投資証券
ダイナミック・アルファ(米ドル)
クラスP - a c c 投資証券
ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券

上限見込額は以下のとおりである。

グローバル・アロケーション(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

18億6,200万米ドル(約1,927億円)

円建クラスP - a c c 投資証券

1,449億2,000万円

グローバル・アロケーション(ユーロ)

クラスP - a c c 投資証券

16億3,000万ユーロ(約2,069億円)

ダイナミック・アルファ(米ドル)

クラスP - a c c 投資証券

12億6,680万米ドル(約1,311億円)

ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券

9億8,810万ユーロ(約1,254億円)

(注1) 上限見込額は、便宜上、各サブ・ファンドの投資証券の2020年12月末日現在の1口当たりの純資産価格に基づいて算出されている。(グローバル・アロケーション(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については18.62米ドルに1億口、グローバル・アロケーション(米ドル)円建クラスP - a c c 投資証券については14,492円に1,000万口、グローバル・アロケーション(ユーロ)クラスP - a c c 投資証券については16.30ユーロに1億口、ダイナミック・アルファ(米ドル)クラスP - a c c 投資証券については126.68米ドルに1,000万口およびダイナミック・アルファ(米ドル)ユーロ・ヘッジクラスP - a c c 投資証券については98.81ユーロに1,000万口をそれぞれ乗じて算出した金額である。)

(注2) 米ドルおよびユーロの円貨換算は、便宜上、2020年12月30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米ドル=103.50円および1ユーロ=126.95円)による。

(注3) ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設立されているが、投資証券は米ドル建て、ユーロ建てまたは円建てのため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルまたはユーロまたは円貨をもって行う。

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年3月31日に提出した有価証券届出書(2021年4月30日付、2021年6月30日付、2021年8月3日付および2021年8月10日付有価証券届出書の訂正届出書により訂正済)(以下「原届出書」といいます。)について、2022年1月31日付でファンドの設立地における目論見書が変更され、投資方針、投資制限、投資リスク、手数料等及び税金ならびに役員等の状況等が変更されましたので、これに関する記載を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

(注)下線または傍線部は訂正部分を示します。

2【訂正の内容】

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

2 投資方針

(1) 投資方針

<訂正前>

(前略)

サステナビリティ・エクスクルージョン・ポリシー

投資運用会社のサステナビリティ・エクスクルージョン・ポリシーは、すべてのアクティブな投資戦略に適用される除外(エクスクルージョン)事項を概説したものであり、ひいてはアクティブ運用を行う投資信託の投資ユニバースを制限するものである。

(中略)

グローバル・アロケーション(米ドル)

グローバル・アロケーション(ユーロ)

(中略)

この目的を達成するために、サブ・ファンドは、直接または間接的に、既存のUCIおよびUCITSを通じて上記の投資方針の枠内において投資を行う。かかる投資を行う際、投資の35%を限度に格付けがBB+からC(スタンダード・アンド・プアーズ)または別の公認格付機関から同等の格付けを得ている債券を保有することができ、まだ公的な格付けがない新規発行銘柄に関してはユービーエス社内の同等の格付けとする。ただし、CCCからCの格付けの債券については10%を超えないものとする。格付けがBB+からCの投資対象は、一流の発行体の証券への投資に比べて平均を上回る利回りがあるが、信用リスクも大きくなることがある。投資者には、損失リスクが増大する可能性について明確に知らせる。

(後略)

<訂正後>

(前略)

サステナビリティ・エクスクルージョン・ポリシー

投資運用会社のサステナビリティ・エクスクルージョン・ポリシーは、サブ・ファンドの投資ユニバースに適用される除外(エクスクルージョン)事項を概説したものである。

(中略)

グローバル・アロケーション(米ドル)

グローバル・アロケーション(ユーロ)

(中略)

この目的を達成するために、サブ・ファンドは、直接または間接的に、既存のUCIおよびUCITSを通じて上記の投資方針の枠内において投資を行う。かかる投資を行う際、投資の35%を限度に八

イ・イールド商品に投資することができる。ハイ・イールド商品には、ハイ・イールド債、ハイ・イールド・ファンドおよびハイ・イールド指数デリバティブを含む。ハイ・イールドの投資とは、格付けがBB+からC(スタンダード・アンド・プアーズ)または別の公認格付機関から同等の格付けを得ているか、まだ公的な格付けがない新規発行銘柄に関してはユービーエス社内の同等の格付けへの投資を含む。ただし、CCCからCの格付けの債券への直接の投資については10%を超えないものとする。格付けがBB+からCの投資対象は、一流の発行体の証券への投資に比べて平均を上回る利回りがあるが、信用リスクも大きくなる可能性がある。投資者には、損失リスクが増大する可能性について明確に知らせる。

(後略)

(4) 投資制限

<訂正前>

(前略)

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

(中略)

一般的に、以下の要件がトータル・リターン・スワップに適用される。

() トータル・リターン・スワップから得た純リターン100%から直接および間接の運営コスト/費用を差し引いたものがサブ・ファンドに戻される。

(後略)

<訂正後>

(前略)

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

(中略)

一般的に、以下の要件がトータル・リターン・スワップに適用される。

() トータル・リターン・スワップから得た総リターン100%から直接および間接の運営コスト/費用を差し引いたものがサブ・ファンドに戻される。

(後略)

3 投資リスク

<訂正前>

リスク要因

(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
グローバル・アロケーション(米ドル)	0% - 10%	50%	0%	10%	60%	100%

(後略)

<訂正後>

リスク要因

(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
グローバル・アロケーション(米ドル)	0% - 10%	50%	0%	10%	60%	75%

(後略)

4 手数料等及び税金

(4) その他の手数料等

<訂正前>

(前略)

各サブ・ファンドの投資方針の条項により、その他のUCIまたはUCITSに投資することができるサブ・ファンドの場合、サブ・ファンドだけでなく、関係する投資先ファンドのレベルでも費用が発生する。サブ・ファンドの資産が投資される対象ファンドの管理報酬は、販売報酬を考慮して最大で3.00%となる場合がある。

(後略)

<訂正後>

(前略)

各サブ・ファンドの投資方針の条項により、その他のUCIまたはUCITSに投資することができるサブ・ファンドの場合、サブ・ファンドだけでなく、関係する投資先ファンドのレベルでも費用が発生する。サブ・ファンドの資産が投資される対象ファンドの管理報酬(成功報酬を除く。)は、販売報酬を考慮して最大で3.00%となる場合がある。

(後略)

(5) 課税上の取扱い

<訂正前>

(前略)

ルクセンブルグ

(中略)

2018年ドイツ投資税法に基づく部分的課税免除

(中略)

以下のサブ・ファンドは、同法第20条第(2)項に基づく部分的課税免除の適用を目的として同法第2条第(7)項に規定される「ミックス・ファンド」の適格要件を満たすため、各資産の25%以上をエクイティ投資対象(同法第(8)項および関連ガイドラインに定義される。)に継続的に投資する。

- ・ UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - 中国株・ロング・ショート(米ドル)
- ・ UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - デジタル・トランスフォーメーション・ダイナミック(米ドル)

(後略)

<訂正後>

(前略)

ルクセンブルグ

(中略)

2018年ドイツ投資税法に基づく部分的課税免除

(中略)

以下のサブ・ファンドは、同法第20条第(2)項に基づく部分的課税免除の適用を目的として同法第2条第(7)項に規定される「ミックス・ファンド」の適格要件を満たすため、各資産の25%以上をエクイティ投資対象(同法第(8)項および関連ガイドラインに定義される。)に継続的に投資する。

- ・ UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - 中国株・アンコンストレインド(米ドル)
- ・ UBS (Lux) キー・セレクション・シキャブ - デジタル・トランスフォーメーション・ダイナミック(米ドル)

(後略)

第三部 外国投資法人の詳細情報

第1 外国投資法人の追加情報

2 役員の状況

<訂正前>

(2021年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ロバート・シュティンガー (Robert Süttinger)	チェアマン	UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、チューリッヒ マネージング・ディレクター	該当なし
フランチェスカ・ガニーニ (Francesca Guagnini)	メンバー・オブ・ザ・ボード	UBS アセット・マネジメント(UK)リミテッド、ロンドン マネージング・ディレクター	該当なし
トーマス・ローズ (Thomas Rose)	メンバー・オブ・ザ・ボード	UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、チューリッヒ マネージング・ディレクター	該当なし
ラファエル・シュミット・リヒター (Raphael Schmidt-Richter)	メンバー・オブ・ザ・ボード	UBS アセット・マネジメント(ドイツ)ゲーエムベーハー、フランクフルト エグゼクティブ・ディレクター	該当なし

(注) 本投資法人に従業員はいない。本投資法人の独立監査人は、アーンスト・アンド・ヤング・エス・エイである。

<訂正後>

(2022年1月31日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ロバート・シュティンガー (Robert Süttinger)	チェアマン	UBS アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、チューリッヒ マネージング・ディレクター	該当なし
フランチェスカ・ガニーニ (Francesca Guagnini)	メンバー・オブ・ザ・ボード	UBS アセット・マネジメント(UK)リミテッド、ロンドン マネージング・ディレクター	該当なし

ジョゼ・リンダ・デニス (Josée Lynda Denis)	メンバー・オブ・ ザ・ボード	ルクセンブルグ インディペンデント・ディレク ター	該当なし
トーマス・ローズ (Thomas Rose)	メンバー・オブ・ ザ・ボード	UBS アセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー、チューリッ ヒ マネージング・ディレクター	該当なし
ラファエル・シュミット・リ ヒター (Raphael Schmidt-Richter)	メンバー・オブ・ ザ・ボード	UBS アセット・マネジメント (ドイツ) ゲーエムベーハー、フ ランクフルト エグゼクティブ・ディレクター	該当なし

(注) 本投資法人に従業員はいない。本投資法人の独立監査人は、アーンスト・アンド・ヤング・エス・エイである。

第2 手続等

4 その他

< 訂正前 >

(前略)

指数提供者

ブルームバーグ・バークレイズ

BLOOMBERG®は、ブルームバーグ・ファイナンス・エルピーの商標およびサービスマークである。
BARCLAYS®は、バークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークであり、使用許諾に基づき使用される。ブルームバーグ・ファイナンス・エルピーおよびその関連会社(ブルームバーグ・インデックス・サービシズ・リミテッドを含む。)(総称して、以下「ブルームバーグ」という。)またはブルームバーグのライセンサーは、販売目論見書に記載されるブルームバーグ・バークレイズの指数におけるすべての所有権を有する。

(中略)

ベンチマーク規則

販売目論見書に別段の定めがない限り、販売目論見書の日付においてサブ・ファンドがベンチマークとして使用する指数(規則(EU)2016/1011(以下「ベンチマーク規則」という。))に基づき定義される「使用」)は、ベンチマーク規則第36条に従ってESMAが保管するベンチマーク管理者登録簿に記載されるベンチマーク管理者により提供される。

ベンチマークがESMAのベンチマーク管理者登録簿または第三国のベンチマーク登録簿に含まれる管理者によって提供されるか否かについての最新情報は、<https://registers.esma.europa.eu/publication/>で入手可能である。

ベンチマークに重大な変更が生じた場合またはベンチマークが停止された場合、管理会社は、ベンチマーク規則第28条(2)で要求されるとおり、かかる場合に取りべき措置を含む書面による危機管理計画を有している。投資主は、管理会社の登記上の事務所において当該危機管理計画について無料で相談することができる。

< 訂正後 >

(前略)

指数提供者

ブルームバーグ

BLOOMBERG®は、ブルームバーグ・ファイナンス・エルピーの商標およびサービスマークである。ブルームバーグ・ファイナンス・エルピーおよびその関連会社(ブルームバーグ・インデックス・サービシズ・

リミテッドを含む。) (総称して、以下「ブルームバーグ」という。) またはブルームバーグのライセンサーは、販売目論見書に記載されるブルームバーグの指数におけるすべての所有権を有する。

(中略)

ベンチマーク規則

販売目論見書の日付においてサブ・ファンドがベンチマークとして使用する指数(規則(EU)2016/1011(以下「ベンチマーク規則」という。))に基づき定義される「使用」は、以下のすべてまたはいずれかのベンチマーク管理者が提供する。

() ベンチマーク規則第36条に従ってESMAが保管する管理者およびベンチマークの登録簿に記載されているベンチマーク管理者。ベンチマークがEUベンチマーク管理者および第三国ベンチマークのESMA登録簿に記載されている管理者によって提供されるか否かについての最新情報は、<https://registers.esma.europa.eu>で入手可能である。

() ベンチマーク規則に規定される第三国のベンチマーク管理者の地位を有しており、かつ、FCAが保管する管理者およびベンチマークの登録簿(この登録簿は<https://register.fca.org.uk/BenchmarksRegister>で入手可能である。)に記載されている、英国の2019年ベンチマーク(変更および移行規定)(EU離脱)規則(以下「英国ベンチマーク規則」という。)に基づき認可を受けたベンチマーク管理者。

() ベンチマーク規則に基づく移行措置が適用されるため、ESMAが保管する管理者およびベンチマークの登録簿にまだ記載されていないベンチマーク管理者。

ベンチマーク管理者の移行期間およびベンチマーク規則に基づく管理者としての認可または登録の申請期限は、関係するベンチマークの分類およびベンチマーク管理者の住所地の両方によって決まる。

ベンチマークに重大な変更が生じた場合またはベンチマークが停止された場合、管理会社は、ベンチマーク規則第28条(2)で要求されるとおり、かかる場合に取りべき措置を含む書面による危機管理計画を有している。投資主は、管理会社の登記上の事務所において当該危機管理計画について無料で相談することができる。

第4 関係法人の状況

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)

UBS SuMi TRUST ウェルス・マネジメント株式会社(「代行協会員」「日本における販売会社」)

a. 資本金(株主資本)の額

2021年6月末日現在、5,000万円

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

UBS SuMi TRUST ウェルス・マネジメント株式会社(「代行協会員」「日本における販売会社」)

a. 資本金(株主資本)の額

2021年12月末日現在、5,165百万円

(後略)

第四部 特別情報

第3 その他

< 訂正前 >

(前略)

交付目論見書の概要

(中略)

<p>その他の費用、 手数料</p>	<p>- 本投資法人は、本投資法人の資産の管理、設立、変更、清算および合併に関する一切の追加の費用、手数料およびその他の報酬ならびに本投資法人の所得および資産に賦課されるすべての租税、特にルクセンブルグの年次税(0.05%)を負担します。</p> <p>(中略)</p> <p>- 各サブ・ファンドの投資方針の条項により、その他のUCIまたはUCITSに投資することができるサブ・ファンドの場合、サブ・ファンドだけでなく、関係する投資先ファンドのレベルでも費用が発生します。サブ・ファンドの資産が投資される対象ファンドの管理報酬は、販売報酬を考慮して最大で3.00%となる場合があります。</p> <p>その他の費用については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p>
------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(後略)

<訂正後>

(前略)

交付目論見書の概要

(中略)

<p>その他の費用、 手数料</p>	<p>- 本投資法人は、本投資法人の資産の管理、設立、変更、清算および合併に関する一切の追加の費用、手数料およびその他の報酬ならびに本投資法人の所得および資産に賦課されるすべての租税、特にルクセンブルグの年次税(0.05%)を負担します。</p> <p>(中略)</p> <p>- 各サブ・ファンドの投資方針の条項により、その他のUCIまたはUCITSに投資することができるサブ・ファンドの場合、サブ・ファンドだけでなく、関係する投資先ファンドのレベルでも費用が発生します。サブ・ファンドの資産が投資される対象ファンドの管理報酬(成功報酬を除きます。)は、販売報酬を考慮して最大で3.00%となる場合があります。</p> <p>その他の費用については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p>
------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(後略)