

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年9月1日提出
【発行者名】	B N Yメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 遠藤 勝利
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号 丸の内トラストタワー本館
【事務連絡者氏名】	吉田 紀明
【電話番号】	03(6756)4683
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】	モビリティ・イノベーション・ファンド
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券の 金額】	5,000億円を上限とします。
【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】

2021年4月21日付をもって提出し、2021年4月22日にその届出の効力が生じた有価証券届出書（2021年5月28日および2021年7月14日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原届出書」といいます。）の記載事項につきまして、マザーファンドの投資顧問会社が運用に関する事業の一部を譲渡し、新会社にて運用を行うことになりましたので、その訂正を行うため、本訂正届出書を提出いたします。

2【訂正の内容】

原届出書の下記事項のうち、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部_____は訂正部分を示します。

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】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(省 略)

ファンドの特色

(省 略)

b. ポートフォリオの構築にあたっては、次の方針で行うことを基本とします。

(省 略)

上記は、当資料作成時点のものであり、今後、予告なしに変更される場合があります。
出所：メロン・インベストメンツ・コーポレーション

c. マザーファンドの実質的な運用は、メロン・インベストメンツ・コーポレーションに運用の指図に関する権限を委託します。



(省 略)

<訂正後>

(省 略)

ファンドの特色

(省 略)

b. ポートフォリオの構築にあたっては、次の方針で行うことを基本とします。

(省 略)

上記は、当資料作成時点のものであり、今後、予告なしに変更される場合があります。
出所：ニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシー

c. マザーファンドの実質的な運用は、ニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシーに運用の指図に関する権限を委託します。

ニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシー

ニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシー（以下、同社といいます）は、同じBNYメロン・グループ傘下の運用会社である「メロン・インベストメンツ・コーポレーション」から株式およびマルチアセット運用に関する事業を承継し、2021年9月1日からマザーファンドの運用を開始した運用会社です。当該変更により、マザーファンドの運用哲学、運用プロセスには変更はございません。同社は、BNYメロン・グループ傘下の運用会社グループである「ニュートン・インベストメント・マネジメント」の北米拠点で、米国マサチューセッツ州ボストンに本社を置きます。

本社：米国ボストン

（省 略）

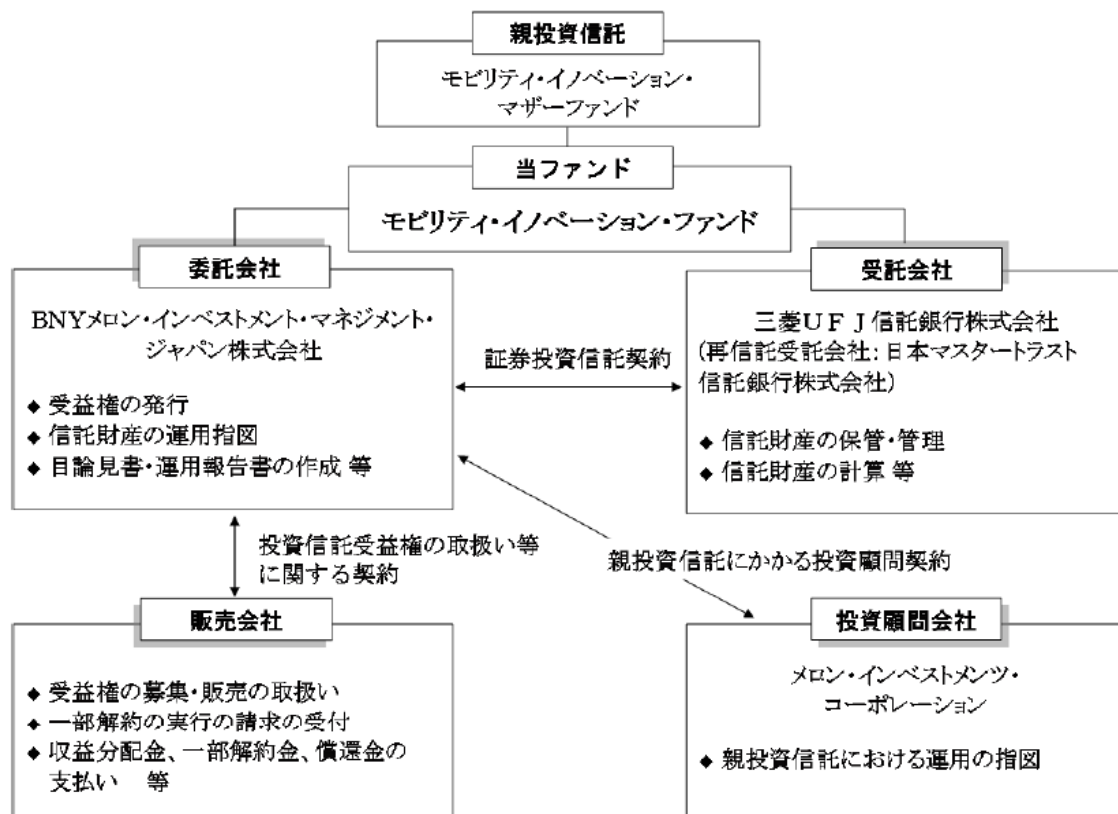
（3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

（省 略）

ファンドの関係法人

（省 略）



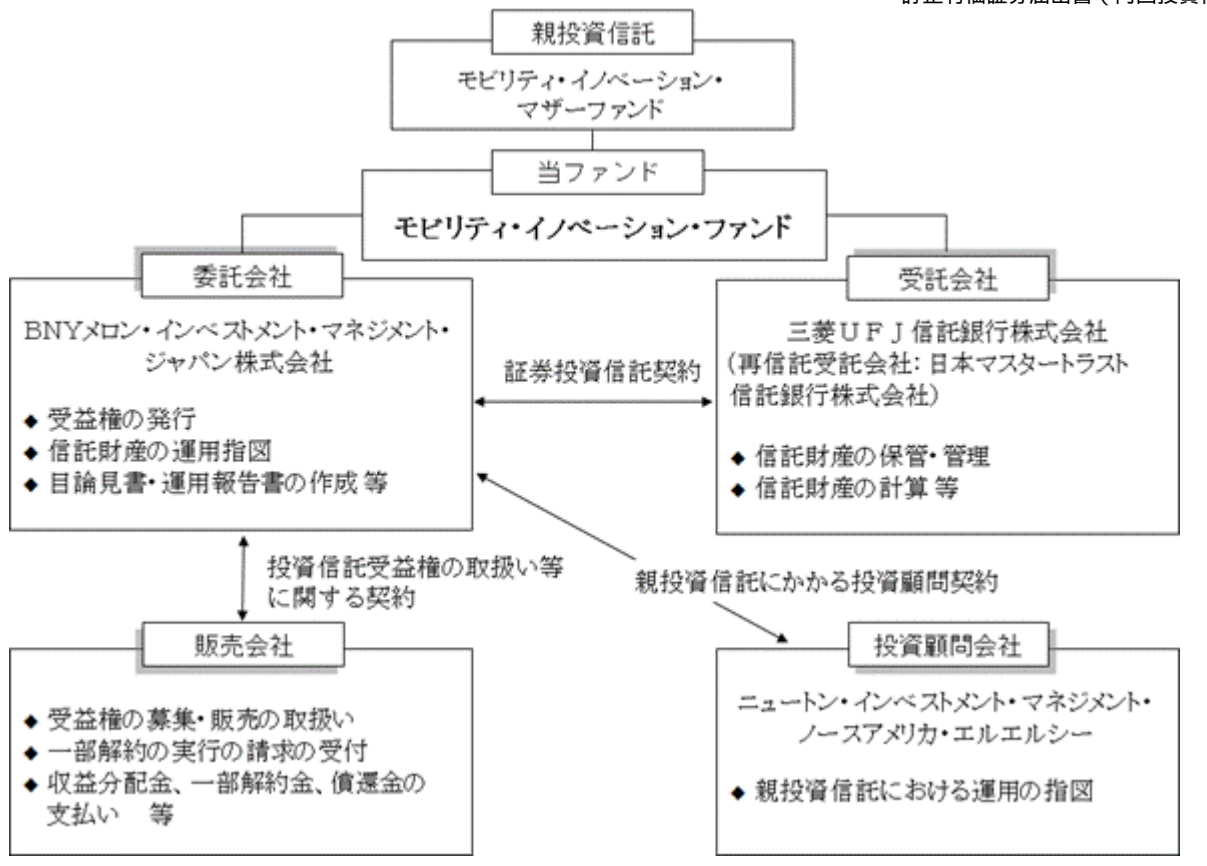
（省 略）

<訂正後>

（省 略）

ファンドの関係法人

（省 略）



(省 略)

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<訂正前>

(省 略)

<参考情報> マザーファンドの投資方針

(省 略)

運用方法

(省 略)

b. 投資態度

(省 略)

4. 運用にあたっては、メロン・インベストメンツ・コーポレーションに運用の指図権限の一部を委託します。

(省 略)

<訂正後>

(省 略)

<参考情報> マザーファンドの投資方針

(省 略)

運用方法

(省 略)

b. 投資態度

(省 略)

4. 運用にあたっては、ニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシーに運用の指図権限の一部を委託します。

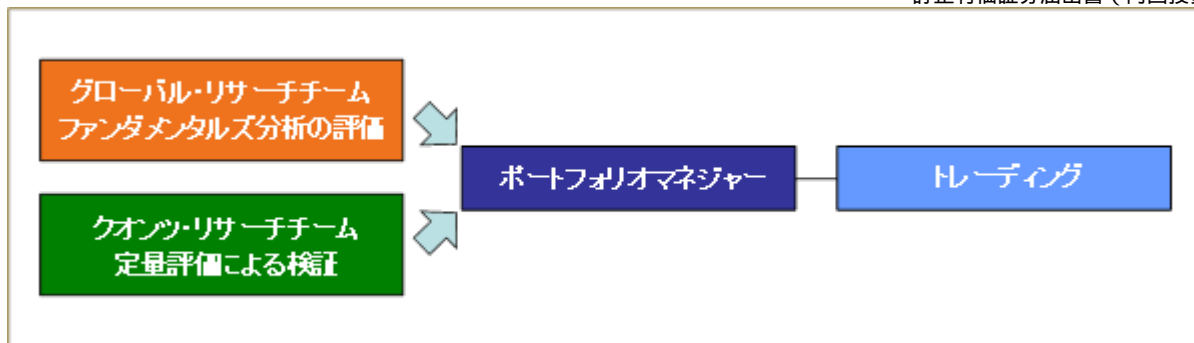
(省 略)

(3)【運用体制】

<訂正前>

(省 略)

マザーファンドに関する投資顧問会社の運用体制



（注）上記の運用体制は2021年1月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

<訂正後>

（省略）

マザーファンドに関する投資顧問会社の運用体制



（注）上記の運用体制は2021年9月1日現在のものであり、今後変更される場合があります。

3【投資リスク】

(2) リスク管理体制

<訂正前>

（省略）

（参考）マザーファンドに関する投資顧問会社のリスク管理体制

リスク管理は運用に関わる全ての従業員が責任を持ち、全体のリスク管理フレームワークの中で機能的な役割を担っています。

[個別銘柄レベルのリスク管理]

リサーチ・アナリストは、担当する企業の主要ビジネス、経済的、政治的なリスクに関わる責任を持ちます。さらに、ESGオフィサーと協働し、環境、社会、ガバナンスに関する問題が企業に及ぼす影響も考慮します。また、定量分析は特定の銘柄のリスク特性や他の企業との関連性を理解するのに活用されます。

[ポートフォリオレベルのリスク管理]

ポートフォリオ・マネージャーはポートフォリオの運用リスクを理解し、管理する責任を持ちます。定量リサーチグループが運用リスクの測定及び管理を通じて、ポートフォリオ・マネージャーの責任を支援しています。このグループは自社開発、もしくは外部のリスク管理モデルやツールを活用し、ポートフォリオのリスク測定やシナリオ分析、将来のシステムティックリスクへの影響などを評価しています。また、ポートフォリオ・マネージャーはポートフォリオ・インプリメンテーション&トレーディングチームのサポートを得て、流動性リスクやカウンターパーティーリスクの測定、監視、管理を行っています。

[戦略グループレベルのリスク管理]

投資戦略は、アクティブ債券戦略、アクティブ株式戦略、インデックス&複合資産の3つに大別され、それぞれの戦略にCIO（チーフ・インベストメント・オフィサー）がいます。CIOは各投資戦略内におけるポートフォリオ・マネージャーや運用チームを監督する責任を持ちます。パフォーマンス測定チームの分析レポートのサポートを得て、CIOは定期的にポートフォリオ・マネージャーのリスク・リターンを確認しています。

役割に基づく機能的運用リスク管理に加え、当社では独立したリスク監視プロセスも確保されています。

このリスク監視体制は専属のリスク管理人員、リスク管理室、測定および報告のインフラ、決められた許容範囲レベル、運用リスク委員会および確立されたエスカレーション処理（上部組織体への報告対応等）手続きなどから構成されています。

（注）上記の管理体制は2021年1月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

<訂正後>

（省略）

（参考）マザーファンドに関する投資顧問会社のリスク管理体制

リスク管理とは単にリスクの低減を意図するものではなく、運用ガイドラインに則った適切なリスクをとることと考え、包括的、統合的、多層的なリスク管理アプローチを確立しています。全社的なリスク管理の枠組みの中で、運用メンバーを含む全スタッフがそれぞれの役割と権限においてリスク管理を実行し、運用プロセスにおいて適切なリスク水準へと調整される仕組みとなっています。また独立したリスク管理監視システムも活用し、専任の担当者によって適宜モニタリングがなされ、必要に応じて運用リスク委員会、また社内に報告する体制を整えています。

主なモニタリング項目としては以下のようなものが挙げられます。

- ・個別企業およびセクターエクスポージャー
- ・金利エクスポージャー
- ・カウンター・パーティーエクスポージャー
- ・流動性

（注）上記の管理体制は2021年9月1日現在のものであり、今後変更される場合があります。

第三部【委託会社等の情報】

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>

（省略）

(3) 投資顧問会社

名称：メロン・インベストメンツ・コーポレーション

資本金の額：0.5百万米ドル（2020年3月末現在）

（省略）

<訂正後>

（省略）

(3) 投資顧問会社

名称：ニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシー

資本金の額：45,801百万米ドル（2020年12月末現在）

同社はザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・コーポレーションの子会社であり、資本金の額を開示していないため、上記の資本金の額はザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・コーポレーションの資本金の額を記載しております。

（省略）