

## 【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5年1月4日

【発行者名】 BNPパリバ・アセットマネジメント・ルクセンブルグ  
(BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg)

【代表者の役職氏名】 チーフ・エグゼクティブ・オフィサー ステファン・ブルネ  
(Chief Executive Officer, Stéphane Brunet)

【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 - 2540、エドワード・スタ  
イケン通り10番  
(10, rue Edward Steichen, L-2540 Luxembourg, Grand Duchy of  
Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 竹野 康造

【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 竹野 康造  
同 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)外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】  
BNPパリバ・グローバル債券ファンド  
(BNP Paribas Global Bond Fund)

【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券の金額】  
米ドル・クラス：  
50億アメリカ合衆国ドル(約5,772億円)  
豪ドル・クラス：  
50億オーストラリア・ドル(約4,039億円)  
ニュージーランド・ドル・クラス：  
50億ニュージーランド・ドル(約3,777億円)

(注1) 各クラスは、それぞれ異なる通貨を参照通貨としており、異なる定めがない限り、金額表示は参照通貨で行う。各クラスの参照通貨は以下の通りである。

米ドル・クラス：

アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)

豪ドル・クラス：

オーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)

ニュージーランド・ドル・クラス：

ニュージーランド・ドル

(注2) 米ドル、豪ドルおよびニュージーランド・ドルの円貨換算は、2022年1月31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である、1米ドル=115.44円、1豪ドル=80.78円および1ニュージーランド・ドル=75.54円による。

【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】

2022年3月31日に提出した有価証券届出書（2022年6月30日付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。）につきまして、2022年10月1日付で、グループ内合併により、保管受託銀行および登録事務・名義書換事務代行会社に変更され、2022年12月31日付で、BNPパリバ・アセットマネジメント・フランスが、投資運用会社を退任し、また、2022年12月付でファンドの設立地における英文目論見書が更新され、ファンドの投資対象、資産の評価規則、スイング・プライシング等が変更されましたので、これら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。

なお、下線の部分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

##### 1 ファンドの性格

##### （2）ファンドの沿革

<訂正前>

（前略）

2020年10月1日 ファンドの修正約款締結

<訂正後>

（前略）

2020年10月1日 ファンドの修正約款締結

2022年12月23日 ファンドの修正約款締結



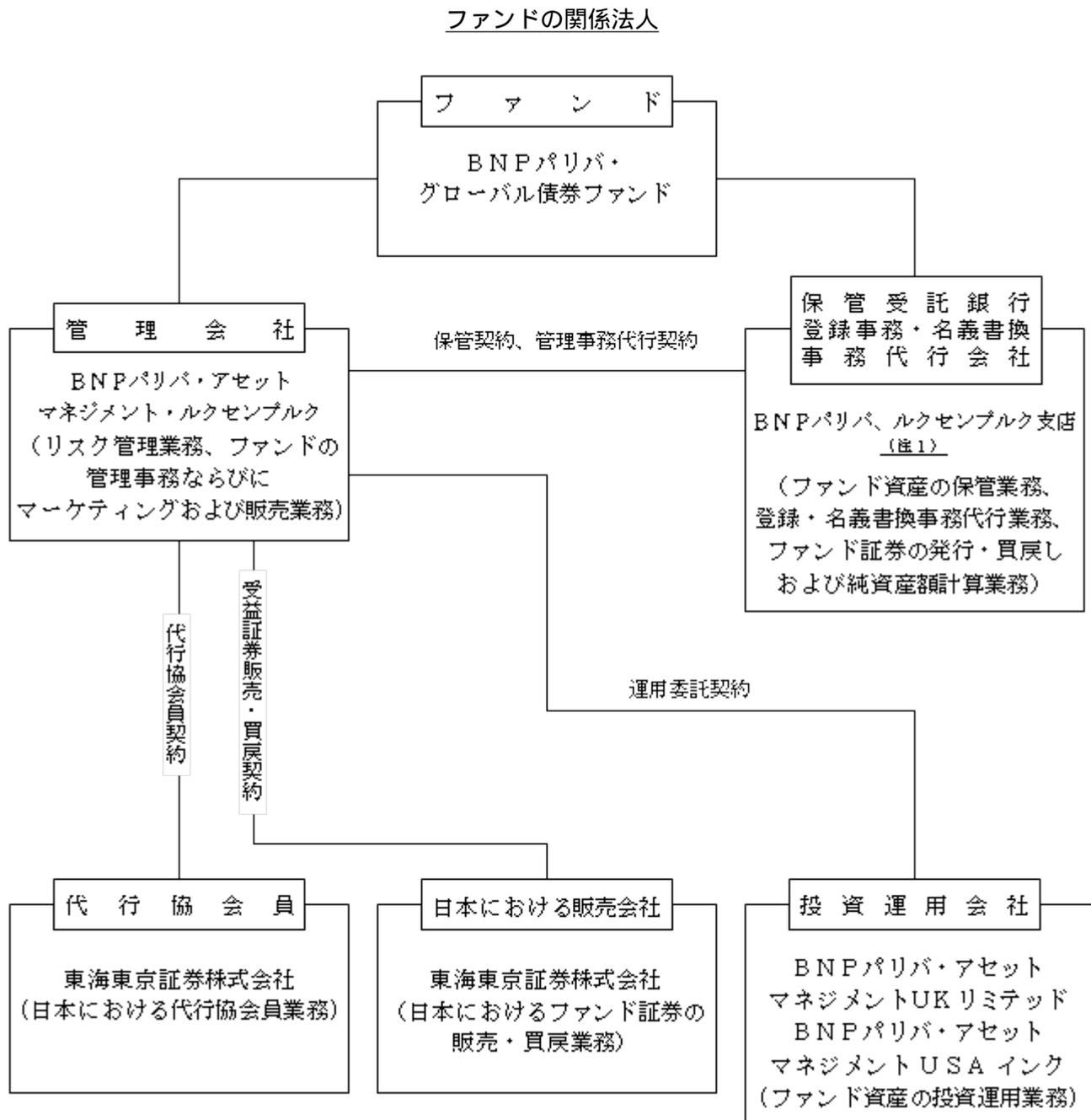
## ファンドの関係法人の名称、ファンド運営上の役割および契約等の概要

名称	ファンドの運営上の役割	契約等の概要
（中略）		
BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッド （BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK Ltd）	投資運用会社	2014年7月22日付で管理会社との間で運用委託契約（注1）を締結。同契約はファンド資産に関する運用業務について規定している。
BNPパリバ・アセットマネジメント・フランス （BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France）	投資運用会社	管理会社との間で2020年10月1日効力発生 <u>の運用委託契約（注1）を締結。同契約はファンド資産に関する運用業務について規定している。</u>
BNPパリバ・アセットマネジメント USA インク （BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT USA, Inc.）	投資運用会社	管理会社との間で2020年10月1日効力発生 <u>の運用委託契約（注1）を締結。同契約はファンド資産に関する運用業務について規定している。</u>
BNP パリバ・セキュリ ティーズ・サービス、ルクセ ンブルク支店 （BNP Paribas Securities Services, Luxembourg Branch）	保管受託銀行 登録事務・名義書換事務 代行会社	2014年7月22日付で、管理会社との間で保管契約（注2）を締結（2016年12月2日付で改訂済）。同契約はファンド資産の保管業務等について規定している。 2014年7月22日付で管理会社との間で管理事務代行契約（注3）を締結。同契約は登録および名義書換事務の代行業務について規定している。

（後略）

&lt;訂正後&gt;

## ファンドの仕組み



(注1) 2022年10月1日付で、グループ内合併により、BNPパリバ・セキュリティーズ・サービス、ルクセンブルク支店から、BNPパリバ、ルクセンブルク支店に変更された。

(注2) 2022年12月31日付で、BNPパリバ・アセットマネジメント・フランスが、投資運用会社を退任した。

## ファンドの関係法人の名称、ファンド運営上の役割および契約等の概要

名称	ファンドの運営上の役割	契約等の概要
（中略）		
BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッド （BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK Ltd）	投資運用会社	2014年7月22日付で管理会社との間で運用委託契約（注1）を締結。同契約はファンド資産に関する運用業務について規定している。
BNPパリバ・アセットマネジメントUSAインク （BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT USA, Inc.）	投資運用会社	管理会社との間で2020年10月1日効力発生の運用委託契約（注1）を締結。同契約はファンド資産に関する運用業務について規定している。
BNPパリバ、ルクセンブルク支店 （BNP Paribas, Luxembourg Branch）	保管受託銀行 登録事務・名義書換事務 代行会社	2014年7月22日付で、管理会社との間で保管契約（注2）を締結（2016年12月2日付で改訂済）。同契約はファンド資産の保管業務等について規定している。 2014年7月22日付で管理会社との間で管理事務代行契約（注3）を締結。同契約は登録および名義書換事務の代行業務について規定している。

（後略）

## （4）ファンドに係る法制度の概要

&lt;訂正前&gt;

## （イ）ファンドの形態

（中略）

その保管をBNPパリバ・セキュリティーズ・サービスズ、ルクセンブルク支店（以下「保管受託銀行」という。）に委託されているファンドの資産は、管理会社の資産とは分別される。受益者は、ファンドの受益証券を取得することにより、受益者、管理会社および保管受託銀行の間の契約関係を定める約款（以下「約款」という。）にすべて同意する。

（後略）

&lt;訂正後&gt;

## （イ）ファンドの形態

（中略）

その保管をBNPパリバ、ルクセンブルク支店（以下「保管受託銀行」という。）に委託されているファンドの資産は、管理会社の資産とは分別される。受益者は、ファンドの受益証券を取得することにより、受益者、管理会社および保管受託銀行の間の契約関係を定める約款（以下「約款」という。）にすべて同意する。

（後略）

## （5）開示制度の概要

&lt;訂正前&gt;

ルクセンブルクにおける開示

（中略）

（ロ）受益者に対する開示

（中略）

財務報告書

（中略）

ファンドの財務報告書は米ドルで表示される。  
年次報告書は会計年度末から4か月以内に、半期報告書は半期末から2か月以内に公表される。

（後略）

<訂正後>

ルクセンブルクにおける開示

（中略）

（口）受益者に対する開示

（中略）

財務報告書

（中略）

ファンドの財務報告書は米ドルで表示される。ファンドの財務報告書に使用される会計原則は、ルクセンブルクの一般に公正妥当と認められた会計原則（Lux GAAP）である。

年次報告書は会計年度末から4か月以内に、半期報告書は半期末から2か月以内に公表される。

（後略）

## 2 投資方針

### （2）投資対象

<訂正前>

（前略）

ファンドは、アルゼンチン、ブラジル、中国、インド、インドネシア、ロシア、サウジアラビアおよび南アフリカの政府、中央銀行、行政庁または地方公共団体が発行した単一の債券について、その純資産に対し、a) インデックスにおける当該国の比重の割合、または、b) 5%、のいずれか大きい方を超えて投資を行わない。この目的において、インデックスは、Bloomberg Barclays Capital Global Aggregate\*（米ドルヘッジ付、G20諸国のみ）とJP Morgan EMBI Global\*\*（G20諸国のみ）をそれぞれ50%ずつ加重したものとする。

\* Bloomberg Index Services Limitedが、ベンチマーク・インデックス管理者として、ベンチマーク登録簿に登録されている。

\*\* J.P. Morgan Securities PLCが、ベンチマーク・インデックス管理者として、ベンチマーク登録簿に登録されている。

（中略）

クラス・アクションに関する方針

取締役会は、ファンドが投資する会社の株主総会での投票を含むコーポレート・ガバナンス方針を採択した。取締役会の投票方針を定める主要原則は、会社が株主に、株主の投資に関する透明性および説明責任を提供できる能力に関連し、また、会社は、長期にわたり株式の成長およびリターンを確保するよう経営されるべきであるという点に関連する。取締役会は、誠実に、投資ファンドの受益者の最善の利益を考慮した上で、投票方針を実行するものとする。さらなる参照情報については、ウェブサイト（[www.bnpparibas-am.com](http://www.bnpparibas-am.com)）も閲覧のこと。

方針として、管理会社は、

原則として、積極的なクラス・アクションには参加しない（すなわち、管理会社は、発行体に対するクラス・アクションを提起せず、かかるクラス・アクションにおいて原告として行為せず、またはその他かかるクラス・アクションにおいて積極的な役割を担わない。）。

（中略）

ファンドに適用されるクラス・アクションに関する方針の原則については、管理会社のウェブサイト（<https://www.bnpparibas-am.com>）上で閲覧可能である。

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

ファンドは、アルゼンチン、ブラジル、中国、インド、インドネシア、ロシア、サウジアラビアおよび南アフリカの政府、中央銀行、行政庁または地方公共団体が発行した単一の債券について、その純資産に対し、a) 参照ポートフォリオにおける当該国の比重の割合、または、b) 5%、のいずれか大きい方を超えて投資を行わない。この目的において、参照ポートフォリオは、Bloomberg Barclays Capital Global Aggregate\*（米ドルヘッジ付、G20諸国のみ）とJP Morgan EMBI Global\*\*（G20諸国のみ）をそれぞれ50%ずつ加重したものとする。

\* Bloomberg Index Services Limitedが、「Bloomberg Barclays Capital Global Aggregate（米ドルヘッジ付、ブルームバーグ・ティッカー：LEGATRUH Index）」インデックスのベンチマーク・インデックス管理者である。プレグジット以後、ベンチマーク・インデックス管理者であるBloomberg Index Services Limitedは、ベンチマーク登録簿に登録されていない。2021年1月1日以降、Bloomberg Index Services Limitedは、欧州連合に対して「第三国の」英国管理者とみなされ、ベンチマーク登録簿には記載されていない。非EUのベンチマークは、ベンチマーク規則2016/1011の移行期間（当該期間は、現在、2024年1月1日まで延長されている。）まで、EUで使用されることが認められている。当該期間中、Bloomberg Index Services Limitedは、欧州連合によって英国の「同等」と認められるか、またはベンチマーク規則2016/1011に従い「推奨（endorsement）」または「承認（recognition）」と認められることができる。

\*\* J.P. Morgan Securities PLCが、「JP Morgan EMBI Global（米ドル建て、ブルームバーグ・ティッカー：JPEIGLBL Index）」インデックスのベンチマーク・インデックス管理者である。プレグジット以後、ベンチマーク・インデックス管理者であるJ.P. Morgan Securities PLCは、ベンチマーク登録簿に登録されていない。2021年1月1日以降、J.P. Morgan Securities PLCは、欧州連合に対して「第三国の」英国管理者とみなされ、ベンチマーク登録簿には記載されていない。非EUのベンチマークは、ベンチマーク規則2016/1011の移行期間（当該期間は、現在、2024年1月1日まで延長されている。）まで、EUで使用されることが認められている。当該期間中、J.P. Morgan Securities PLCは、欧州連合によって英国の「同等」と認められるか、またはベンチマーク規則2016/1011に従い「推奨（endorsement）」または「承認（recognition）」と認められることができる。

（中略）

クラス・アクションに関する方針

管理会社は、管理する投資信託（UCI）に適用されるクラス・アクションに関する方針を定めている。クラス・アクションは、通常、同一の（違法な）活動によって被害を受けた複数の者に対する補償を求める集団訴訟手続とされている。

方針として、管理会社は、

原則として、積極的なクラス・アクションには参加しない（すなわち、管理会社は、発行体に対するクラス・アクションを提起せず、かかるクラス・アクションにおいて原告として行為せず、またはその他かかるクラス・アクションにおいて積極的な役割を担わない。）。

（中略）

適用されるクラス・アクションに関する方針の原則については、管理会社のウェブサイト（<https://www.bnpparibas-am.com/en/footer/class-actions-policy/>）上で閲覧可能である。

（後略）

### （３）運用体制

#### <訂正前>

ファンドの運用は投資運用会社に委託されているが、同社の運用については管理会社が全面的に責任を負う。

管理会社は、日常の管理を行う投資運用会社としてBNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッド、BNPパリバ・アセットマネジメント・フランスおよびBNPパリバ・アセットマネジメント USA インクを任命した。

BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッド、BNPパリバ・アセットマネジメント・フランスおよびBNPパリバ・アセットマネジメント USA インクは、BNPパリバ・アセットマネジメント・ホールディングの間接的な完全子会社である。

（後略）

#### <訂正後>

ファンドの運用は投資運用会社に委託されているが、同社の運用については管理会社が全面的に責任を負う。

管理会社は、日常の管理を行う投資運用会社としてBNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッドおよびBNPパリバ・アセットマネジメント USA インクを任命した。

BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッドおよびBNPパリバ・アセットマネジメント USA インクは、BNPパリバ・アセットマネジメント・ホールディングの間接的な完全子会社である。

（後略）

### （５）投資制限

#### <訂正前>

ファンド資産の運用は、管理会社またはその任命を受けた代理人により、ファンドの約款および英文目論見書に規定された以下の投資制限を遵守して遂行される。

ファンドは以下の規定に従う。

（中略）

10. ファンドは、議決権付き株式を取得することはできない。

（後略）

#### <訂正後>

ファンド資産の運用は、管理会社またはその任命を受けた代理人により、ファンドの約款および英文目論見書に規定された以下の投資制限を遵守して遂行される。

ファンドは以下の規定に従う。

（中略）

10. ファンドは、議決権付き受益証券を取得することはできない。

（後略）

## 4 手数料等及び税金

### （５）課税上の取扱い

#### <訂正前>

（前略）

ルクセンブルクと米国外国口座税務コンプライアンス法

（中略）

#### 情報交換

- a) 欧州連合の他の加盟国（フランスの海外県、アゾレス諸島、マデイラ諸島、カナリア諸島、オーランド諸島およびジブラルタルを含む。）の居住者  
居住国以外の国に拠点を置く支払代理人を通じてファンドから分配金またはファンドの証券の売却手取金を受領する個人は、自らに適用される法律上および規制上の規定に関する情報を求めるべきである。

（後略）

<訂正後>

（前略）

ルクセンブルクと米国外国口座税務コンプライアンス法

（中略）

#### 情報交換

- a) 欧州連合の他の加盟国（フランスの海外県、アゾレス諸島、マデイラ諸島、カナリア諸島、オーランド諸島およびジブラルタルを含む。）の居住者  
居住国以外の国に拠点を置く支払代理人を通じてファンドから分配金またはファンドの受益証券の売却手取金を受領する個人は、自らに適用される法律上および規制上の規定に関する情報を求めるべきである。

（後略）

## 第2 管理及び運営

### 3 資産管理等の概要

#### （1）資産の評価

<訂正前>

（前略）

#### 評価規則

ファンドの資産は以下のとおり評価される。

（中略）

- 10 CDSの内部評価モデルは、時価評価額を計算するために、インプットとして、CDSレート・カーブ、リカバリー・レートおよびディスカウント・レート（LIBORまたはマーケット・スワップ・レート）を利用する。この内部モデルはまた、デフォルト確率のレート・カーブも計算する。CDSレート・カーブを確立するために、CDS市場で取引する一定数の相手方からのデータが使用される。管理会社は、相手方のCDSの評価を、内部モデルにより得られた評価と比較するために使用する。内部モデル構築の開始点においては、CDS契約時の際のCDSの変数部分と定数部分は等しい。
- 11 エクイティ・デフォルト・スワップ（以下「EDS」という。）は株式に影響を及ぼす事象により影響を受けるため、その評価は主として株式のボラティリティーおよびその非対称のポジションに依存する。ボラティリティーが大きいほど、株式が70%の閾値に到達するリスクは高くなり、ひいてはEDSスプレッドも大きくなる。株式の大きなボラティリティーは、当該ファンド資産の大きなボラティリティー、ひいては信用事由の高い確率を示すため、ある企業のCDSのスプレッドはまた、そのボラティリティーを反映する。EDSおよびCDSのスプレッドが株式の潜在的なボラティリティーと相関関係があり、その関係が時間の経過につき安定傾向にあると仮定した場合、EDSはCDSの代わりとみなすことができる。EDS評価における重要な点は株式に関係する事象の潜在的な確率を計算することである。一般的に二つの方法が認められている。一つめは、EDSを評価するモデルにおいてインプットとしてCDSの市場スプレッドを使用し、二つめは、確率を推定するために当該株式の過去のデータを使用する。過去のデータは将来起きる可能性のあることに関して必ずしも適切な指針ではないが、

当該データは危機的な状況における株式の一般的な値動きを反映することができる。二つの方法を比較した場合、過去の確率が株式の潜在的な確率より高くなるのは非常に稀有である。

（後略）

<訂正後>

（前略）

#### 評価規則

ファンドの資産は以下のとおり評価される。

（中略）

10 CDSの内部評価モデルは、時価評価額を計算するために、インプットとして、CDSレート・カーブ、リカバリー・レートおよびディスカウント・レート（SOFR/€STRまたはマーケット・スワップ・レート）を利用する。この内部モデルはまた、デフォルト確率のレート・カーブも計算する。CDSレート・カーブを確立するために、CDS市場で取引する一定数の相手方からのデータが使用される。管理会社は、相手方のCDSの評価を、内部モデルにより得られた評価と比較するために使用する。内部モデル構築の開始点においては、CDS契約時の際のCDSの変数部分と定数部分は等しい。

11 エクイティ・デフォルト・スワップ（以下「EDS」という。）は株式に影響を及ぼす事象により影響を受けるため、その評価は主として株式のボラティリティーおよびその非対称のポジションに依存する。ボラティリティーが大きいほど、株式が70%の閾値に到達するリスクは高くなり、ひいてはEDSスプレッドも大きくなる。株式の大きなボラティリティーは、当該ファンド資産の大きなボラティリティー、ひいては信用事由の高い確率を示すため、ある企業のCDSのスプレッドはまた、そのボラティリティーを反映する。EDSおよびCDSのスプレッドが受益証券の潜在的なボラティリティーと相関関係があり、その関係が時間の経過につき安定傾向にあると仮定した場合、EDSはCDSの代わりとみなすことができる。EDS評価における重要な点は株式に関係する事象の潜在的な確率を計算することである。一般的に二つの方法が認められている。一つめは、EDSを評価するモデルにおいてインプットとしてCDSの市場スプレッドを使用し、二つめは、確率を推定するために当該株式の過去のデータを使用する。過去のデータは将来起きる可能性のあることに関して必ずしも適切な指針ではないが、当該データは危機的な状況における株式の一般的な値動きを反映することができる。二つの方法を比較した場合、過去の確率が受益証券の潜在的な確率より高くなるのは非常に稀有である。

（後略）

（5）その他

<訂正前>

（イ）受益証券の純資産価格の計算ならびに発行および買戻しの停止

（中略）

#### スイング・プライシング

一定の市況において、あるカテゴリーまたはクラスの取引高およびかかる取引の規模を考慮した上で、管理会社は、資産の売買価格に基づいて、かつ/または、かかる資産が取引される市場に適用される売値と買値の見積差額を適用することによって、受益証券一口当り純資産価格を計算することが受益者の利益であるとみなすことができる。また、管理会社は、取引手数料および販売手数料のために純資産価額を調整することができる。ただし、かかる手数料は当該時点におけるカテゴリーまたはクラスの純資産価額の1%を上回らない。

（ロ）発行限度額

（後略）

<訂正後>

## (イ) 受益証券の純資産価格の計算ならびに発行および買戻しの停止

(中略)

## スイング・プライシング

ファンドは、投資運用会社により現金の流入を融通するために行われるファンドのポートフォリオ取引に関連する取引費用を反映していない価格で、投資家がファンドを購入、売却および/または転換することで、純資産価額の下落に見舞われることがある。かかる影響を軽減し、既存の受益者の保護を強化するために、「スイング・プライシング」と呼ばれる仕組みが、管理会社の取締役会の裁量で適用されることがある。

かかるスイング・プライシングの仕組みは、その資本活動の総額（すなわち、流入および流出の正味金額）が、既定の評価日における純資産価額の割合として定められた予め決められた閾値を超えた場合、既定のファンドに適用される可能性がある。その後、関連するファンドの純資産価額は、資本活動から生じる予定取引費用を補うために、ある金額だけ調整される（以下「スイング・ファクター」という。）場合がある。閾値のレベルは、場合に応じて、ファンドの規模、各ファンドが投資する原市場の流動性、各ファンドの資金管理または資本活動の管理に使用される商品の種類を含む一定の指標に基づいて決定される。スイング・ファクターは、とりわけ、各ファンドが投資する可能性のある金融商品の取引費用の見積りに基づく。通常、このような調整は、ファンドに正味流入がある場合には、純資産価額を増加させ、正味流出がある場合には、純資産価額を減少させる。スイング・プライシングでは、個々の投資家の取引の個別の状況を考慮しない。スイング・プライシングに関連する運用上の決定の実行および定期的な見直しについては、臨時の内部委員会が担当する。当該委員会は、スイング・プライシングに関する決定および予め決定された継続指示の基礎となるスイング・ファクターの継続的な承認に責任を負う。

原則として、スイング・ファクターは、各ファンドの純資産価額の1%を超えない。しかしながら、例外的な市況の場合には、かかる上限は、その限度額を超えて一時的に引き上げることができ、受益者の利益を保護することができる。かかる例外的な市況には、流動性の深刻な悪化を引き起こす世界的なパンデミック、金融危機、地政学的危機その他の例外的な状況が含まれる。

## (ロ) 発行限度額

(後略)

## 第4 外国投資信託受益証券事務の概要

&lt;訂正前&gt;

## (イ) ファンド証券の名義書換

ファンドの記名式証券の名義書換機関は次の通りである。

取扱機関 BNPパリバ・セキュリティーズ・サービスズ、ルクセンブルク支店

(後略)

&lt;訂正後&gt;

## (イ) ファンド証券の名義書換

ファンドの記名式証券の名義書換機関は次の通りである。

取扱機関 BNPパリバ、ルクセンブルク支店

(後略)

## 第三部 特別情報

### 第1 管理会社の概況

#### 1 管理会社の概況

< 訂正前 >

(前略)

#### (3) 役員及び従業員の状況

(2022年1月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ステファン・ブルネ (Stéphane Brunet)	取締役	BNPパリバ・アセットマネジメント・ルクセンブルク(ルクセンブルク)のチーフ・エグゼクティブ・オフィサー	0
ジョルジュ・エンゲル (Georges Eengel)	取締役	独立取締役 フランス、ヴァンセンヌ	0
ピエール ムーラン (Pierre Moulin)	取締役 (会長)	BNPパリバ・アセットマネジメント・フランス(パリ)のグローバル・ヘッド・オブ・プロダクツ・アンド・ストラテジーズ・マーケティング	0
イザベル・ブルシェ (Isabelle Bourcier)	取締役	BNPパリバ・アセットマネジメント・フランス(パリ)のヘッド・オブ・クアンティティティブ・アンド・インデックス - MAQS (マルチアセット、クアンティティティブ・アンド・ソリューションズ)	0

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

#### (3) 役員及び従業員の状況

(2022年12月30日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ステファン・ブルネ (Stéphane Brunet)	取締役	BNPパリバ・アセットマネジメント・ルクセンブルク(ルクセンブルク)のチーフ・エグゼクティブ・オフィサー	0
ジョルジュ・エンゲル (Georges Eengel)	取締役	独立取締役 フランス、ヴァンセンヌ	0
ピエール ムーラン (Pierre Moulin)	取締役 (会長)	BNPパリバ・アセットマネジメント・フランス(パリ)のグローバル・ヘッド・オブ・プロダクツ・アンド・ストラテジーズ・マーケティング	0
マリー＝ソフィー・パスタント (Marie-Sophie Pastant)	取締役	BNPパリバ・アセットマネジメント・フランス(パリ)のヘッド・オブ・ETF、インデックス・アンド・シンテティック・システムティック・ストラテジーズ・ポートフォリオ・マネジメント	0

(後略)

#### 2 事業の内容及び営業の概況

< 訂正前 >

（前略）

- ・管理事務業務の範囲内において、純資産額の計算業務、登録事務・名義書換事務代行会社の業務をBNPパリバ・セキュリティーズ・サービスズ、ルクセンブルク支店に委託している。

（中略）

#### 保管受託銀行

ファンドの資産の現金監視および保管ならびに管理は、保管受託銀行に委託されており、保管受託銀行は、ルクセンブルク法およびAIFM法により規定される義務および職務を遂行する。

標準的な銀行慣行および現行規制に従って、保管受託銀行は、自らの責任の下、自らが保管している一部または全ての資産を、その他の金融機関または金融仲介機関に委託する。

また、保管受託銀行は以下を確保しなければならない。

- (a) ファンドの受益証券の販売、発行、買戻しおよび取消しがAIFM法および約款に従って行われること。
- (b) 受益証券の価額が2010年12月17日法および約款に従って計算されること。
- (c) AIFM法または約款に抵触しない限り、管理会社の指示を実行すること。
- (d) ファンドの資産に関わる取引において、対価が通常の期限内にトラストに送金されること。
- (e) ファンドの収益が約款に従って充足されること。

#### 監査人

すべてのファンドの会計および取引は、監査人による年次監査の対象とする。

管理会社はBNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッド、BNPパリバ・アセットマネジメント・フランスおよびBNPパリバ・アセットマネジメントUSAインクを日々の運用を行う投資運用会社に任命した。

BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッドは、英国法に基づき1990年2月27日に英国で設立された。BNPパリバ・アセットマネジメント・フランスは、フランス法に基づき1980年7月28日にフランスで設立された。BNPパリバ・アセットマネジメントUSAインクは、米国法に基づき1973年7月5日に米国で設立された。同三社は、パリ市F-75009、ベルジェール通り14番地に所在するBNPパリバ・アセットマネジメントの子会社である。

（後略）

#### <訂正後>

（前略）

- ・管理事務業務の範囲内において、純資産額の計算業務、登録事務・名義書換事務代行会社の業務をBNPパリバ、ルクセンブルク支店に委託している。

（中略）

#### 保管受託銀行

BNPパリバ、ルクセンブルク支店はBNPパリバの支店である。BNPパリバは、パリ商業および法人登記所に番号662 042 449で登録され、健全性監督破綻処理機構（ACPR）により承認され、金融市場庁（AMF）により監督され、（75009）フランス、パリ、イタリア通り16番に登記上の所在地を有し、ルクセンブルク大公国、ルクセンブルクL-1855、J.F.ケネディ通り60番に事務所を有するルクセンブルク支店を通じて行為し、ルクセンブルク商業登記所に番号B23968で登録され、金融監督委員会により監督される、フランスで公開有限会社として設立された認可銀行である。

保管受託銀行は、（ ）監督義務（AIFM法第19条（9）に定義される。）、（ ）ファンドのキャッシュフローの監視（AIFM法第19条（7）に規定される。）、および（ ）ファンドの資産の保管（AIFM法第19条（8）に規定される。）の3種類の業務を遂行する。

監督義務に基づき、保管受託銀行は、以下を行うことを要求される。

- (a) ファンドのために行われる受益証券の販売、発行、買戻し、償還および取消しがAIFM法または約款に従って行われることを確保すること。
- (b) 受益証券の価額がAIFM法および約款に従って計算されること。

- (c) A I F M法または約款に抵触しない限り、ファンドのために行為する管理会社の指示を実行すること。
- (d) ファンドの資産に関わる取引において、対価が通常の期限内にファンドに送金されることを確保すること。
- (e) ファンドの収益がA I F M法および約款に従って配分されることを確保すること。

#### 監査人

すべてのファンドの会計および取引は、監査人による年次監査の対象とする。

管理会社はBNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッドおよびBNPパリバ・アセットマネジメント USA インクを日々の運用を行う投資運用会社に任命した。

BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッドは、英国法に基づき1990年2月27日に英国で設立された。BNPパリバ・アセットマネジメント USA インクは、米国法に基づき1973年7月5日に米国で設立された。同社は、パリ市F - 75009、ベルジェール通り14番地に所在するBNPパリバ・アセットマネジメントの子会社である。

(後略)

## 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>

- (1) BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッド (BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK Ltd)  
(「投資運用会社」)

(中略)

#### 事業の内容

BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッドは、BNPパリバの会社であり、英国で登記され（登記番号02474627番）、イングランドEC2V7BP、ロンドン、アルダーマンバリー・スクエア5番に登記上の事業所を有する。同社は、機関投資家および専門投資家のための投資運用会社として事業運営し、BNPパリバの資産運用事業専門のBNPパリバ・アセットマネジメント基盤の一員である。同社は、英国の金融行為監督機構による認可および規制を受ける（会社登録番号は170064番）。

- (2) BNPパリバ・アセットマネジメント・フランス (BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France) (「投資運用会社」)

#### 資本金の額

BNPパリバ・アセットマネジメント・フランスの資本金の額は、2022年1月末日現在、120,340,176ユーロ（約154億8,297万円）である。

#### 事業の内容

BNPパリバ・アセットマネジメント・フランスは、ソシエテ・パー・アクション・シンプリフィー（簡易株式制会社）であり、フランスで設立され、（75009）パリ、オースマン大通り1に登記上の事務所を有し、パリ商業および法人登記所に番号319 378 832で登録されている。BNPパリバ・アセットマネジメント・フランスは、UCITS管理会社としておよびAIFMとして、フランスの監督機関である金融市場庁（AMF）により監督され、金融市場庁に番号GP96002でポートフォリオ管理会社として認可されている。BNPパリバ・アセットマネジメント・フランスは、BNPパリバの資産管理部門であるBNPパリバ・アセットマネジメントの一部である。BNPパリバ・アセットマネジメントは、世界の主要な金融機関の一つであるBNPパリバの投資運用部門である。BNPパリバ・アセットマネジメントは、広範囲にわたる資産クラスおよび地域をカバーする総合的なアクティブ、パッシブおよびクオンツ投資ソリューションを提供する。

- (3) BNPパリバ・アセットマネジメント USA インク (BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT USA, Inc.) (「投資運用会社」)

(中略)

- (4) BNPパリバ・セキュリティーズ・サービスズ、ルクセンブルク支店 (BNP Paribas Securities Services, Luxembourg Branch) (「保管受託銀行」および「登録事務・名義書換事務代行会社」)

資本金の額

BNPパリバ・セキュリティーズ・サービスズの資本金の額は、2022年1月末日現在、182,839,216ユーロ（約235億2,409万円）である。

事業の内容

BNPパリバ・セキュリティーズ・サービスズは、フランス法に基づき株式会社として設立された株式会社であり、パリに登録上の事務所を有するBNPパリバの完全子会社である。BNPパリバ・セキュリティーズ・サービスズのルクセンブルク支店は、2002年6月1日に活動を開始した。

- (5) 東海東京証券株式会社 (「代行協会員」および日本における「販売会社」)

(後略)

<訂正後>

- (1) BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッド (BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK Ltd) (「投資運用会社」)

(中略)

事業の内容

BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッドは、BNPパリバの会社であり、英国で登記され（登記番号02474627番）、英国、EC2V7HR、ロンドン、アルダーマンバリー・スクエア5番に登録上の事業所を有する。同社は、機関投資家および専門投資家のための投資運用会社として事業運営し、BNPパリバの資産運用事業専門のBNPパリバ・アセットマネジメント基盤の一員である。同社は、英国の金融行為監督機構による認可および規制を受ける（会社登録番号は170064番）。

- (2) BNPパリバ・アセットマネジメント USA インク (BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT USA, Inc.) (「投資運用会社」)

(中略)

- (3) BNPパリバ、ルクセンブルク支店 (BNP Paribas, Luxembourg Branch) (「保管受託銀行」および「登録事務・名義書換事務代行会社」)

資本金の額

BNPパリバ、ルクセンブルク支店は、BNPパリバ・エス・エイの支店である。BNPパリバ・エス・エイの資本金の額は、2022年10月1日現在、2,468,663,292ユーロ（約3,432億1,826万円）である。

(注) ユーロの円貨換算は、2022年8月31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ユーロ = 139.03円）による。

事業の内容

BNPパリバ、ルクセンブルク支店は、フランス法に基づき公開有限会社として設立された認可銀行であるBNPパリバ・エス・エイの支店である。BNPパリバ、ルクセンブルク支店は、BNPパリバ・セキュリティーズ・サービスズ、ルクセンブルク支店の名前で、2002年6月1日に活動を開始した。

- (4) 東海東京証券株式会社 (「代行協会員」および日本における「販売会社」)

（後略）

## 2 関係業務の概要

< 訂正前 >

- (1) BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッド (BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK Ltd)  
(「投資運用会社」)  
ファンド資産について投資運用業務を行う。
- (2) BNPパリバ・アセットマネジメント・フランス (BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France) (「投資運用会社」)  
ファンド資産について投資運用業務を行う。
- (3) BNPパリバ・アセットマネジメント USA インク (BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT USA, Inc.) (「投資運用会社」)  
ファンド資産について投資運用業務を行う。
- (4) BNPパリバ・セキュリティーズ・サービスズ、ルクセンブルク支店 (BNP Paribas Securities Services, Luxembourg Branch) (「保管受託銀行」および「登録事務・名義書換事務代行会社」)  
管理会社との契約に基づき、ファンド資産の保管業務、登録事務・名義書換事務代行業務および純資産額計算業務を行う。
- (5) 東海東京証券株式会社 (「代行協会員」および日本における「販売会社」)  
日本における代行協会員業務およびファンド証券の販売・買戻業務を行う。

< 訂正後 >

- (1) BNPパリバ・アセットマネジメントUKリミテッド (BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK Ltd)  
(「投資運用会社」)  
ファンド資産について投資運用業務を行う。
- (2) BNPパリバ・アセットマネジメント USA インク (BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT USA, Inc.) (「投資運用会社」)  
ファンド資産について投資運用業務を行う。
- (3) BNPパリバ、ルクセンブルク支店 (BNP Paribas, Luxembourg Branch) (「保管受託銀行」および「登録事務・名義書換事務代行会社」)  
管理会社との契約に基づき、ファンド資産の保管業務、登録事務・名義書換事務代行業務および純資産額計算業務を行う。
- (4) 東海東京証券株式会社 (「代行協会員」および日本における「販売会社」)  
日本における代行協会員業務およびファンド証券の販売・買戻業務を行う。

## 3 資本関係

< 訂正前 >

管理会社、投資運用会社および保管受託銀行はすべてBNPパリバ・エス・エイの直接または間接の子会社である。

< 訂正後 >

管理会社および投資運用会社はBNPパリバ・エス・エイの直接または間接の子会社であり、保管受託銀行はBNPパリバ・エス・エイの支店である。

## 第4 その他

### <訂正前>

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

(中略)

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがある。

- ・ EDINET(金融庁の開示書類閲覧ホームページ)で有価証券届出書等が開示されているので、詳細情報の内容はWEBサイト(<https://disclosure.edinet-fsa.go.jp/>)でも閲覧することができる。

(後略)

### <訂正後>

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

(中略)

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがある。

- ・ EDINET(金融庁の開示書類閲覧ホームページ)で有価証券届出書等が開示されているので、詳細情報の内容はWEBサイト(<https://disclosure2.edinet-fsa.go.jp/>)でも閲覧することができる。

(後略)