

【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】 2023年12月5日

【発行者名】 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 高村 孝

【本店の所在の場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【事務連絡者氏名】 久保 政喜

【電話番号】 03 - 4530 - 7297

【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】 ステート・ストリート新興国株式インデックス・オープン

【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】 6,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

**【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

2023年2月15日に提出いたしました有価証券届出書（2023年8月15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。）について、記載事項の一部に変更がありますので、本訂正届出書を提出するものです。

**【訂正箇所および訂正事項】**

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部\_\_\_\_\_は、訂正部分を示します。なお、図もしくは表が含まれる部分については、下線を省略する場合があります。

## 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>

当ファンドは、MA（マルチアセット）ファンドシリーズ の一つであり、新興国の株式を主要投資対象とした「エマージング株式インデックス・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資することにより、中長期的にMSCIエマージング・マーケット・インデックス（円ベース）の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。

<略>

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル			
一般					
大型株	年2回	日本			
中小型株	年4回	北米			日経225
債券			<b>ファミリー ファンド</b>	あり ( )	
一般	年6回	欧州			
公債	(隔月)	アジア			
社債					
その他債券	年12回				TOPIX
クレジット属性 ( )	(毎月)	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
<b>その他資産</b>	その他	アフリカ			<b>その他</b>
<b>(投資信託証券</b>	( )				<b>(MSCIエマージン</b>
<b>(株式 一般))</b>		中近東 (中東)			<b>グ・マーケット・</b>
					<b>インデックス</b>
					<b>(円ベース))</b>
資産複合					
資産配分固定型		<b>エマージング</b>			
資産配分変動型					

<略>

## 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投資以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載は、組入資産を表します。
決算頻度	年1回	目論見書又は信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	エマージング	目論見書又は信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資形態	ファミリー ファンド	目論見書又は信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	なし	目論見書又は信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他 (MSCIエマージング・ マーケット・ インデックス (円ベース))	「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

&lt; 略 &gt;

## ファンドの特色

- 1 マザーファンドへの投資を通じて、新興国の株式等に投資します。
- 2 当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。  
●ファミリーファンド方式については、「ファンドの仕組み」をご覧ください。
- 3 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。  
●MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、世界の主要新興国の株式で構成される株価指数であり、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース)を当ファンドおよび投資対象とするマザーファンドのベンチマークとします。  
●投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。
- 4 実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。  
●投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

## 投資対象とするマザーファンドの概要

## ■ エマージング株式インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	新興国の取引所上場株式(これに準ずるものを含みます。)
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース)をベンチマークとします。</li> <li>・ 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</li> <li>・ 外貨建資産については、ベンチマークとの連動性を維持することを目的とする場合を除き、原則として為替ヘッジを行いません。</li> </ul>

※投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

< 略 >

## &lt; 訂正後 &gt;

当ファンドは、MA（マルチアセット）ファンドシリーズ の一つであり、新興国の株式を主要投資対象とした「エマージング株式インデックス・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資することにより、中長期的にMSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。

&lt; 略 &gt;

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル			
一般					
大型株	年2回	日本			
中小型株					
	年4回	北米			日経225
債券			<b>ファミリー ファンド</b>	あり ( )	
一般	年6回	欧州			
公債	(隔月)				
社債		アジア			
その他債券	年12回				TOPIX
クレジット属性 ( )	(毎月)	オセアニア			
	日々	中南米			
不動産投信			ファンド・オブ・ ファンズ	<b>なし</b>	
<b>その他資産</b>	その他	アフリカ			<b>その他</b>
<b>(投資信託証券</b>					<b>(MSCIエマージン</b>
<b>(株式 一般))</b>	( )				<b>グ・マーケット・</b>
		中近東 (中東)			<b>インデックス</b>
					<b>(配当込み、</b>
					<b>円換算ベース))</b>
資産複合					
資産配分固定型		<b>エマージング</b>			
資産配分変動型					

&lt; 略 &gt;

## 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投資以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載は、組入資産を表します。
決算頻度	年1回	目論見書又は信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	エマージング	目論見書又は信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資形態	ファミリー ファンド	目論見書又は信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	なし	目論見書又は信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他 (MSCIエマージング・ マーケット・ インデックス (配当込み、 円換算ベース))	「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

&lt;略&gt;

## ファンドの特色

- 1 マザーファンドへの投資を通じて、新興国の株式等に投資します。
- 2 当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。
  - ファミリーファンド方式については、「ファンドの仕組み」をご覧ください。
- 3 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
  - MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、世界の主要新興国の株式で構成される株価指数であり、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)を当ファンドおよび投資対象とするマザーファンドのベンチマークとします。
  - 投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。
- 4 実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
  - 投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

**投資対象とするマザーファンドの概要****■ エマージング株式インデックス・マザーファンド**

<b>運用の基本方針</b>	中長期的な観点から、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
<b>主要投資対象</b>	新興国の取引所上場株式(これに準ずるものを含みます。)
<b>投資態度</b>	<ul style="list-style-type: none"><li>・ MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)をベンチマークとします。</li><li>・ 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</li><li>・ 外貨建資産については、ベンチマークとの連動性を維持することを目的とする場合を除き、原則として為替ヘッジを行いません。</li></ul>

※投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

< 略 >

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <訂正前>

当ファンドは、マザーファンド受益証券に投資することにより、中長期的にMSCIエマージング・マーケット・インデックス（円ベース）の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。

<略>

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円ベース）をベンチマークとします。

#### <訂正後>

当ファンドは、マザーファンド受益証券に投資することにより、中長期的にMSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。

<略>

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）をベンチマークとします。

<略>

### (5)【投資制限】

<略>

(参考)「エマージング株式インデックス・マザーファンド」の概要

<略>

### (1)投資方針

#### <訂正前>

この投資信託は、新興国の株式を主要投資対象とし、中長期的に新興国の株式市場（MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円ベース））の動きに連動した投資成果の獲得をめざして運用を行う事を基本とします。

新興国の取引所上場株式（これに準ずるものを含む）を主要投資対象とします。

MSCI エマージング・マーケット・インデックスの構成国の株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位を維持します。

外貨建資産については、ベンチマークとの連動性を維持することを目的とする場合を除き、原則として為替ヘッジを行いません。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいう。）を減じるため、ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現するために限定して、デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限ります。以下同じ。）を行うことができます。

— 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。

— 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

## &lt; 訂正後 &gt;

この投資信託は、新興国の株式を主要投資対象とし、中長期的に新興国の株式市場（MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース））の動きに連動した投資成果の獲得をめざして運用を行う事を基本とします。

新興国の取引所上場株式（これに準ずるものを含む）を主要投資対象とします。

MSCI エマージング・マーケット・インデックスの構成国の株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とし、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位を維持します。

外貨建資産については、ベンチマークとの連動性を維持することを目的とする場合を除き、原則として為替ヘッジを行いません。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいう。以下同じ。）を減じるため、ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現するために限定して、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスクを減じるため、ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現するために限定して、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスクを減じるため、ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現するために限定して、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスクを減じるため、ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現するために限定して、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスクを減じるため、ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現するために限定して、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

### （３）主な投資制限

<略>

#### <訂正前>

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### <訂正後>

委託会社は、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### 3【投資リスク】

< 略 >

#### (3) リスク管理体制

< 訂正前 >

< 略 >

#### ■「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

##### 日本株: TOPIX(東証株価指数、配当込み)

TOPIX(東証株価指数、配当込み)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

##### 先進国株: MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

##### 新興国株: MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

##### 日本国債: NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

##### 先進国債: FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

##### 新興国債: JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

< 訂正後 >

< 略 >

#### ■「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

##### 日本株: TOPIX(東証株価指数、配当込み)

TOPIX(東証株価指数、配当込み)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

##### 先進国株: MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

##### 新興国株: MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

##### 日本国債: NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

##### 先進国債: FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

##### 新興国債: JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円換算ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円換算ベース)は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

## 4【手数料等及び税金】

&lt; 略 &gt;

## (2)【換金（解約）手数料】

&lt; 訂正前 &gt;

換金手数料はありません。

ただし、換金時に信託財産留保額（換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.25%の率を乗じて得た額）が差し引かれます。

&lt; 訂正後 &gt;

換金手数料はありません。

## (3)【信託報酬等】

&lt; 訂正前 &gt;

信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に年率0.319%（税抜0.29%）の信託報酬率を乗じて得た額とします。

&lt; 略 &gt;

支払先	信託報酬率（年率）	役務の内容
委託会社	0.25%	委託した資金の運用、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	0.01%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	0.03%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

&lt; 略 &gt;

&lt; 訂正後 &gt;

信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に年率0.1012%（税抜0.092%）の信託報酬率を乗じて得た額とします。

&lt; 略 &gt;

支払先	信託報酬率（年率）	役務の内容
委託会社	0.052%	委託した資金の運用、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	0.01%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	0.03%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

&lt; 略 &gt;

## 第2【管理及び運営】

< 略 >

### 2【換金（解約）手続等】

< 訂正前 >

< 略 >

- 4) 解約価額（換金価額）は、換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額です。換金価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。換金価額の照会方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。
- 5) 信託財産留保額は、上記4）の基準価額に0.25%の率を乗じて得た額とします。上記金額は1口当たりの金額です。換金口数に応じてご負担いただきます。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

- 4) 解約価額（換金価額）は、換金申込受付日の翌営業日の基準価額です。換金価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。換金価額の照会方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。
- 5) 信託財産留保額はありませぬ。

< 略 >