

【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13日

【発行者名】 SBIアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 梅本 賢一

【本店の所在の場所】 東京都港区六本木一丁目6番1号

【事務連絡者氏名】 山下 明美

【電話番号】 03-6229-0170

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券に係るファンドの名称】 SBI S&P500パリ協定 インデックス・ファンド

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券の金額】 上限5,000億円

【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】

2023年7月20日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、「SBI S & P 500 pari 協定 インデックス・ファンド」の主要投資対象である「SBI S & P 500 pari 協定 インデックス・マザーファンド」の投資対象ETFが合併されたことに伴い、また、一部記載の変更を行うため、本訂正届出書により訂正を行うものです。

2【訂正箇所および訂正事項】

<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、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。

第一部【証券情報】

(4)【発行（売出）価格】

(略)

() 基準価額の算出頻度・照会方法等

基準価額は毎営業日算出されます。最新の基準価額（1万口当たり）は販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊にも掲載されています。

<訂正前>

委託会社における照会先：

SBIアセットマネジメント株式会社（委託会社）
電話番号 03 - 6229 - 0097（受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時）
ホームページ <http://www.sbiam.co.jp/>

<訂正後>

委託会社における照会先：

SBIアセットマネジメント株式会社（委託会社）
電話番号 03 - 6229 - 0097（受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時）
ホームページ <https://www.sbiam.co.jp/>

第二部【ファンド情報】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

この投資信託（以下「本ファンド」という場合があります。）は、S&P500パリ協定準拠気候指数（円換算ベース）に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

<訂正前>

* S&P500パリ協定準拠気候指数とは、米国の代表的な株価指数であるS&P500指数採用銘柄の中から、パリ協定温室効果ガス排出削減目標を実践しようとする企業で構成される株価指数です。英語では「S&P500 Paris-Aligned Climate Net Total Return Index」と表記されます。なお、S&P500パリ協定準拠気候指数（円換算ベース）は、S&P500パリ協定準拠気候指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

<訂正後>

* S&P500パリ協定準拠気候指数とは、米国の代表的な株価指数であるS&P500指数採用銘柄の中から、パリ協定温室効果ガス排出削減目標を実践しようとする企業で構成される株価指数です。英語では「S&P500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG+ Index」と表記されます。なお、S&P500パリ協定準拠気候指数（円換算ベース）は、S&P500パリ協定準拠気候指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

ファンドの特色

<訂正前>

- ① **パリ協定温室効果ガス排出削減目標を実践しようとする企業で構成される株価指数への運動をめざします。**
 - SBI S&P500/パリ協定 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。)受益証券への投資を通じて、S&P500/パリ協定準拠気候指数(円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。
- ② **マザーファンド受益証券は、主としてETF(上場投資信託証券)に投資します。**
 - Amundi Asset Management SASが運用を行う「リクソー NET ZERO 2050 S&P500/パリ協定 ETF」を実質的な主要投資対象とします。
- ③ **実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。**

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

追加的記載事項

※当ファンドはESG投信ではありません。



「欧州サステナブルファイナンス開示規制(SFDR)」に基づく分類について

投資対象ファンドである「リクソー NET ZERO 2050 S&P500/パリ協定 ETF」は、欧州サステナブルファイナンス開示規制(Sustainable Finance Disclosure Requirement、以下「SFDR」)において、第8条に分類されています。

SFDRとは金融市場参加者における持続可能性に関するルールを標準化することにより、持続可能性に係るリスク評価の透明性を高めることを目的としたもので、最終投資家が金融商品を比較しやすくすることで、「グリーンウォッシング(環境に配慮しているように装うこと)」を防止することも目的の一つとされています。2021年3月より、EU(欧州連合)で新たに導入されたもので、金融機関においてはサステナブル特性に基づき、運用するファンドを第6条、第8条、第9条の3つのカテゴリーに分類し、当該カテゴリー条件の遵守やその定期報告等が求められるようになりました。

S&P500 Paris-Aligned Climate Net Total Return Indexは、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(SPDJI)の商品であり、これを利用するライセンスがSBIアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC([S&P])の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC([Dow Jones])の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがSBIアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。本ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切の責任を負いません。

<訂正後>

- 1 パリ協定温室効果ガス排出削減目標を実践しようとする企業で構成される株価指数への運動をめざします。
 - SBI S&P500パリ協定 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。)受益証券への投資を通じて、S&P500パリ協定準拠気候指数(円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。
- 2 マザーファンド受益証券は、主としてETF(上場投資信託証券)に投資します。
 - Amundi Asset Management SASが運用を行う「Amundi S&P500 Climate Net Zero Ambition PAB UCITS ETF」を実質的な主要投資対象とします。
- 3 実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

追加的記載事項

※当ファンドはESG投信ではありません。

【欧州サステナブルファイナンス開示規制(SFDR)に基づく分類について

投資対象ファンドである「Amundi S&P500 Climate Net Zero Ambition PAB UCITS ETF」は、欧州サステナブルファイナンス開示規制(Sustainable Finance Disclosure Requirement、以下「SFDR」)において、第8条に分類されています。

SFDRとは金融市場参加者における持続可能性に関するルールを標準化することにより、持続可能性に係るリスク評価の透明性を高めることを目的としたもので、最終投資家が金融商品を比較しやすくすることで、「グリーンウォッシング(環境に配慮しているように装うこと)」を防止することも目的の一つとされています。2021年3月より、EU(欧州連合)で新たに導入されたもので、金融機関においてはサステナブル特性に基づき、運用するファンドを第6条、第8条、第9条の3つのカテゴリーに分類し、当該カテゴリー条件の遵守やその定期報告等が求められるようになりました。

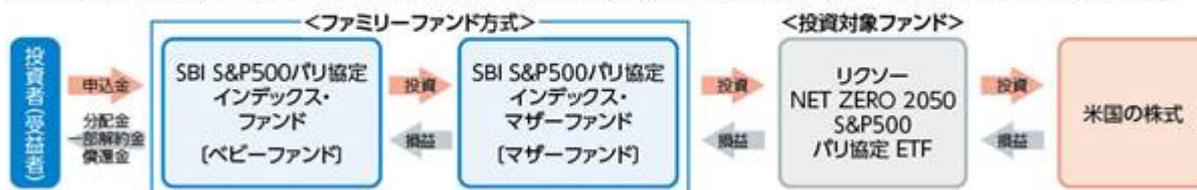
対象インデックスは、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(SPDJI)の商品であり、これを利用するライセンスがSBIアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC([S&P])の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC([Dow Jones])の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがSBIアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。本ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切の責任を負いません。

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

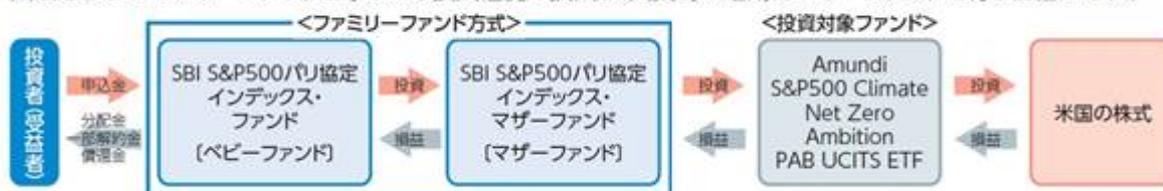
<訂正前>

本ファンドの運用は、ファミリーファンド方式で行います。ファミリーファンド方式とは、投資信託(ベビーファンド)の資金をまとめてマザーファンドと呼ばれる投資信託に投資し、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。



<訂正後>

本ファンドの運用は、ファミリーファンド方式で行います。ファミリーファンド方式とは、投資信託(ベビーファンド)の資金をまとめてマザーファンドと呼ばれる投資信託に投資し、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。



2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

1. 基本方針

本ファンドは、S&P500パリ協定準拠気候指数（円換算ベース）に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

<訂正前>

* S&P500パリ協定準拠気候指数とは、米国の代表的な株価指数であるS&P500指数採用銘柄の中から、パリ協定温室効果ガス排出削減目標を実践しようとする企業で構成される株価指数です。英語では「S&P500 Paris-Aligned Climate Net Total Return Index」と表記されます。なお、S&P500パリ協定準拠気候指数（円換算ベース）は、S&P500パリ協定準拠気候指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

<訂正後>

* S&P500パリ協定準拠気候指数とは、米国の代表的な株価指数であるS&P500指数採用銘柄の中から、パリ協定温室効果ガス排出削減目標を実践しようとする企業で構成される株価指数です。英語では「S&P500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG+ Index」と表記されます。なお、S&P500パリ協定準拠気候指数（円換算ベース）は、S&P500パリ協定準拠気候指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

(2) 【投資対象】

(略)

(参考情報) 投資対象ファンドの概要

マザーファンド受益証券を通じて、実質的に投資する投資対象ファンドの概要です（2023年4月末日現在）。

<訂正前>

名 称	リクソー NET ZERO 2050 S&P500パリ協定 ETF (Lyxor Net Zero 2050 S&P500 Climate PAB (DR) UCITS ETF)
種 別	E T F (上場投資信託証券)
運 用 方 針	S&P500パリ協定準拠気候指数 (S&P500 Paris-Aligned Climate Net Total Return Index) に連動する投資成果をめざします。 米国の代表的な株価指数であるS&P500指数採用銘柄の中から、パリ協定温室効果ガス排出削減目標を実践しようとする企業で構成される株価指数です。
基 準 通 貨	米ドル
管 理 報 酬 等	純資産総額に対し年0.07%
委 託 会 社	Amundi Asset Management SAS / 所在地：フランス共和国

上記内容は、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

名 称	Amundi S&P500 Climate Net Zero Ambition PAB UCITS ETF
種 別	E T F (上場投資信託証券)
運 用 方 針	S&P500パリ協定準拠気候指数 (S&P500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG+ Index) に連動する投資成果をめざします。 米国の代表的な株価指数であるS&P500指数採用銘柄の中から、パリ協定温室効果ガス排出削減目標を実践しようとする企業で構成される株価指数です。
基 準 通 貨	米ドル
管 理 報 酬 等	純資産総額に対し年0.07%
委 託 会 社	Amundi Asset Management SAS / 所在地：フランス共和国

上記内容は、今後変更となる場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（ ）お申込日

毎営業日お申込いただけます。

原則として、営業日の午後3時までに販売会社が受付けた分を当日のお申込みとします。

上記時間を過ぎての受付は、翌営業日の取扱いとなります。

ただし、継続申込期間中は、次のいずれかに該当する場合には、購入・換金のお申込みの受付を行いません。

<訂正前>

- ・ニューヨークの証券取引所の休業日
- ・ニューヨークの商業銀行の休業日
- ・ロンドンの証券取引所の休業日
- ・ロンドンの商業銀行の休業日
- ・委託会社の指定する日

詳しくは販売会社へお問い合わせください。なお、下記照会先においてもご確認いただけます。

委託会社における照会先：

SBIアセットマネジメント株式会社（委託会社） 電話番号 03 - 6229 - 0097（受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時） ホームページ http://www.sbi-am.co.jp/

<訂正後>

- ・ニューヨークの証券取引所の休業日
- ・ニューヨークの商業銀行の休業日
- ・ドイツの証券取引所の休業日
- ・ドイツの商業銀行の休業日
- ・委託会社の指定する日

詳しくは販売会社へお問い合わせください。なお、下記照会先においてもご確認いただけます。

委託会社における照会先：

SBIアセットマネジメント株式会社（委託会社） 電話番号 03 - 6229 - 0097（受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時） ホームページ https://www.sbi-am.co.jp/

2 【換金（解約）手続等】

a . 換金の受付

毎営業日お申込みいただけます。

原則として営業日の午後3時までには販売会社が受付けた分を当日のお申込みとします。

上記時間を過ぎての受付は、翌営業日のお取扱いとなります。

ただし、換金申込日当日が次のいずれかに該当する場合には、購入・換金のお申込みの受付を行いません。

<訂正前>

- ・ニューヨークの証券取引所の休業日
- ・ニューヨークの商業銀行の休業日
- ・ロンドンの証券取引所の休業日
- ・ロンドンの商業銀行の休業日
- ・委託会社の指定する日

詳しくは販売会社へお問い合わせください。なお、下記照会先においてもご確認いただけます。

委託会社における照会先：

SBIアセットマネジメント株式会社（委託会社）
電話番号 03 - 6229 - 0097（受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時）
ホームページ <http://www.sbi-am.co.jp/>

<訂正後>

- ・ニューヨークの証券取引所の休業日
- ・ニューヨークの商業銀行の休業日
- ・ドイツの証券取引所の休業日
- ・ドイツの商業銀行の休業日
- ・委託会社の指定する日

詳しくは販売会社へお問い合わせください。なお、下記照会先においてもご確認いただけます。

委託会社における照会先：

SBIアセットマネジメント株式会社（委託会社）
電話番号 03 - 6229 - 0097（受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時）
ホームページ <https://www.sbi-am.co.jp/>

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

(略)

() 基準価額の算出頻度・照会方法等

本ファンドの基準価額は毎営業日算出されます。最新の基準価額（1万口当たり）は最寄りの取扱販売会社にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします。また、日本経済新聞にも原則として計算日の翌日付の朝刊に基準価額（1万口当たり）が掲載されています。なお、下記照会先においてもご確認いただけます。

<訂正前>

託会社における照会先：

SBIアセットマネジメント株式会社（委託会社）
電話番号 03 - 6229 - 0097（受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時）
ホームページ <http://www.sbi-am.co.jp/>

<訂正後>

託会社における照会先：

SBIアセットマネジメント株式会社（委託会社）
電話番号 03 - 6229 - 0097（受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時）
ホームページ <https://www.sbi-am.co.jp/>

(5) 【その他】

(略)

() 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<訂正前>

<http://www.sbi-am.co.jp/>

(略)

<訂正後>

<https://www.sbi-am.co.jp/>

(略)