

【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】	2025年9月25日提出
【発行者名】	ニッセイ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 大関 洋
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託業務部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【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】	ニッセイ・S日本半導体株式インデックスファンド <購入・換金手数料なし>
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】	当初募集額 上限1,000億円 継続募集額 上限1兆円
【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】

2024年8月9日をもって提出した有価証券届出書（2025年5月15日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」ということがあります）の記載事項を、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドにおける有価証券の取引等の規制に関する内閣府令第59条第1項第14号の規定に基づく売買等の計画の変更にともない、新たな内容に改めるため本訂正届出書を提出します。

【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第三部【委託会社等の情報】

第3【その他】

<訂正前>

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
 - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せは、委託会社のコールセンターで承っております。
 - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
- なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
- コールセンター 0120-762-506
(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)
ホームページ <https://www.nam.co.jp/>
- (4) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- 投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- (8) 当ファンドは「Solactive Nippon Semiconductor Opportunity インデックス（配当込み）」の動きに連動する投資成果をめざし、当ファンドの主要投資対象であるニッセイ日本半導体株式インデックスマザーファンドでは、「完全法」による運用を行います。
- 委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）は、当該完全法を行うにあたり、有価証券の取引等の規制に関する内閣府令第59条第1項第14号の規定に関し、次に記載の売買等を行う計画を有しています。
- なお、次に記載の計画においては、当ファンドのベンチマークである「Solactive Nippon Semiconductor Opportunity インデックス（配当込み）」を「Solactive Nippon Semiconductor Opportunity Index（配当込み）」と表記しています。

1. 対象ファンド

ニッセイ日本半導体株式インデックス マザーファンド

2. 売買等の計画

Solactive Nippon Semiconductor Opportunity Index（配当込み）をベンチマークとする完全法による運用を行う。

(1) 売買等の別及び期日

① 現物株式組入比率の調整の場合

✓ ファンドにおいて、現物株式の組入比率が閾値を超過した場合に、組入比率が基準値となるように目標追加売買金額を決定する。

・ 現物株式の組入比率

$$\frac{\text{前営業日の現物時価総額} + \text{前営業日の未収配当}}{\text{前営業日の純資産総額} + \text{前営業日申込キャッシュフロー} + \text{当日申込キャッシュフロー}} \times 100$$

・ ファンド設定日

基準値：90%

・ 当初募集期間終了日

ファンド閾値：89%～99%、基準値：90%

・ ファンド設定日以降

※ただし、ファンド設定日及び当初募集期間終了日は含まない

ファンド閾値：95～99%、基準値：97.5%

✓ 売買の別

・ 目標のベンチマーク構成比に合わせる売買を行う。（算出方法は（2）①を参照）

✓ 期日

・ ファンド設定日においては、ファンド設定日当日に執行する。何らかの事情により約定が未執行となった場合は、翌営業日以降、取引が行えるまで継続する。

・ ファンド設定日以降（ただしファンド設定日は含まない）は閾値超過を確認した日の翌営業日に執行する。何らかの事情により約定が未執行となった場合は、翌々営業日以降、取引が行えるまで継続する。

② ベンチマーク構成銘柄の異動の場合

✓ 売買の別

・ ベンチマーク変更後の構成比に合わせる売買を行う。（算出方法は（2）②を参照）

✓ 期日

・ ベンチマーク構成銘柄の異動日の前営業日に執行する。但し、異動の発表が異動前営業日の売買立会時間終了後の場合は、異動日に執行する。

・ 何らかの事情により約定が未執行となった場合は、翌営業日以降、取引が行えるまで継続する。

③ 現物株式ポートフォリオの調整の場合

✓ 推定トラッキングエラーが閾値（20bp）を超過した場合に売買を行う。

✓ 売買の別

・ 目標のベンチマーク構成比に合わせる売買を行う。（算出方法は（2）③を参照）

✓ 期日

- ・ 閾値超過を確認した日の翌営業日に執行する。何らかの事情により約定が未執行となった場合は、翌営業日以降、取引が行えるまで継続する。

④キャッシュ残高の赤残（資金不足）が見込まれる場合

- ✓ ①、②、③の場合には該当しないが、当日+3営業日までの間にキャッシュ残高の赤残（資金不足）が見込まれる場合は、赤残が見込まれる日のキャッシュ比率が基準値となるように目標売却金額を決定する。

・ キャッシュ比率

$$\frac{\text{赤残が見込まれる日のキャッシュ残高}}{\text{前営業日の純資産総額} + \text{前営業日申込キャッシュフロー} + \text{当日申込キャッシュフロー}} \times 100$$

・ 基準値：2.5%

✓ 売買の別

- ・ 目標のベンチマーク構成比に合わせる売買を行う。（算出方法は（2）④を参照）

✓ 期日

- ・ 当日に執行する。何らかの事情により約定が未執行となった場合は、翌営業日以降、取引が行えるまで継続する。

(2) 売買等の期日における売買等の銘柄、総額又は数

①現物株式組入比率の調整の場合

- ✓ Solactive Nippon Semiconductor Opportunity Index（配当込み）採用銘柄全てについて、各銘柄の株価（期日の前営業日の大引値）、指数用株式数（期日の翌営業日）を掛け合わせて、各銘柄の構成ウェイトを計算する。
- ✓ 期日の前営業日の現物時価総額に目標追加売買金額（算出方法は（1）①を参照）を加減した金額に、上記各銘柄の構成ウェイトを掛けることで、銘柄毎の目標の保有金額・保有株数を算出する。
- ✓ 上記銘柄毎の目標の保有株数に対し、実際ファンドで保有する株数との過不足株数を計算し、過不足分のある銘柄について売買を行う。

②ベンチマーク構成銘柄の異動、③現物株式ポートフォリオの調整の場合

- ✓ 目標追加売買金額を0として、①と同様の方法で各銘柄の売買株数を算出する。
- ✓ 当該売買反映後の現物株式の組入比率を計算した結果、組入比率が閾値を超過する場合は、①の方法で算出する。

④キャッシュ残高の赤残（資金不足）が見込まれる場合

- ✓ 現物時価総額に目標売却金額（算出方法は（1）④を参照）を減じた金額に、Solactive Japan Semiconductor Opportunistic Index（配当込み）に採用されている各銘柄の構成ウェイトを掛けることで、銘柄毎の目標の保有金額・保有株数を算出する。
- ✓ 上記銘柄毎の目標の保有株数に対し、実際ファンドで保有する株数との過不足株数を計算し、過不足分のある銘柄について売買を行う。

< 策定日 >

2024年7月19日

< 訂正後 >

- （1）目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。

- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者(既にファンドをお持ちの投資者)の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
 - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せは、委託会社のコールセンターで承っております。
 - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
- なお、委託会社(ニッセイアセットマネジメント株式会社)への照会先は下記の通りです。
- コールセンター 0120-762-506
(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)
ホームページ <https://www.nam.co.jp/>
- (4) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- 投資信託説明書(請求目論見書)は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- (8) 当ファンドは「Solactive Nippon Semiconductor Opportunity Index (配当込み)」の動きに連動する投資成果をめざし、当ファンドの主要投資対象であるニッセイ日本半導体株式インデックスマザーファンドでは、「完全法」による運用を行います。
- 委託会社(ニッセイアセットマネジメント株式会社)は、当該完全法を行うにあたり、有価証券の取引等の規制に関する内閣府令第59条第1項第14号の規定に関し、次に記載の売買等を行う計画を有しています。
- なお、次に記載の計画においては、当ファンドのベンチマークである「Solactive Nippon Semiconductor Opportunity インデックス(配当込み)」を「Solactive Nippon Semiconductor Opportunity Index (配当込み)」と表記しています。

1.対象ファンド

ニッセイ日本半導体株式インデックス マザーファンド

2.売買等の計画

Solactive Nippon Semiconductor Opportunity Index（配当込み）をベンチマークとする完全法による運用を行う。

(1)売買等の別及び期日

①現物株式組入比率の調整の場合

- ✓ ファンドにおいて、現物株式の組入比率が閾値を超過した場合に、組入比率が基準値となるように目標追加売買金額を決定する。

- ・ 現物株式の組入比率

（前営業日の現物時価総額＋前営業日の未取配当）÷（前営業日の純資産総額＋前営業日申込キャッシュフロー＋当日申込キャッシュフロー）×100

- ・ ファンド設定日

基準値：90%

- ・ 当初募集期間終了日

ファンド閾値：89%～99%、基準値：90%

- ・ ファンド設定日以降

※ただし、ファンド設定日及び当初募集期間終了日は含まない

ファンド閾値：95～99%、基準値：97.5%

- ✓ 売買の別

- ・ 目標のベンチマーク構成比に合わせる売買を行う。（算出方法は（2）①を参照）

- ✓ 期日

- ・ ファンド設定日においては、ファンド設定日当日に執行する。何らかの事情により約定が未執行となった場合は、翌営業日以降、取引が行えるまで継続する。
- ・ ファンド設定日以降（ただしファンド設定日は含まない）は閾値超過を確認した日の翌営業日に執行する。何らかの事情により約定が未執行となった場合は、翌々営業日以降、取引が行えるまで継続する。

②ベンチマーク構成銘柄の異動の場合

✓ 売買の別

- ・ベンチマーク変更後の構成比に合わせる売買を行う。（算出方法は (2) ②を参照）
- ・ただし、異動となる銘柄の全てで期日が売買不可日となる場合は、当該売買は行わない。

✓ 期日

- ・ベンチマーク構成銘柄の異動日の前営業日に執行する。但し、異動の発表が異動前営業日の売買立会時間終了後の場合は、異動日に執行する。
- ・何らかの事情により約定が未執行となった場合は、翌営業日以降、取引が行えるまで継続する。

③現物株式ポートフォリオの調整の場合

- ✓ 推定トラッキングエラーが閾値（20bp）を超過した場合に売買を行う。

✓ 売買の別

- ・目標のベンチマーク構成比に合わせる売買を行う。（算出方法は (2) ③を参照）

✓ 期日

- ・閾値超過を確認した日の翌営業日に執行する。何らかの事情により約定が未執行となった場合は、翌営業日以降、取引が行えるまで継続する。

④キャッシュ残高の赤残（資金不足）が見込まれる場合

- ✓ ①、②、③の場合には該当しないが、当日＋3営業日までの間にキャッシュ残高の赤残（資金不足）が見込まれる場合は、赤残が見込まれる日のキャッシュ比率が基準値となるように目標売却金額を決定する。

・キャッシュ比率

$$\frac{\text{（赤残が見込まれる日のキャッシュ残高）}}{\text{（前営業日の純資産総額} \\ \text{＋前営業日申込キャッシュフロー＋当日申込キャッシュフロー）}} \times 100$$

- ・基準値：2.5%

✓ 売買の別

- ・目標のベンチマーク構成比に合わせる売買を行う。（算出方法は (2) ④を参照）

✓ 期日

- ・当日に執行する。何らかの事情により約定が未執行となった場合は、翌営業日以降、取引が行えるまで継続する。

(2) 売買等の期日における売買等の銘柄、総額又は数

① 現物株式組入比率の調整の場合

- ✓ Solactive Nippon Semiconductor Opportunity Index（配当込み）採用銘柄全てについて、各銘柄の株価（期日の前営業日の大引値）、指数用株式数（期日の翌営業日）を掛け合わせて、各銘柄の構成ウェイトを計算する。
- ✓ 期日の前営業日の現物時価総額に目標追加売買金額（算出方法は（1）①を参照）を加減した金額に、上記各銘柄の構成ウェイトを掛けることで、銘柄毎の目標の保有金額・保有株数を算出する。
- ✓ 上記銘柄毎の目標の保有株数に対し、実際ファンドで保有する株数との過不足株数を計算し、過不足分のある銘柄について売買を行う。ただし、期日が売買不可日となる銘柄の売買株数は0とする。

② ベンチマーク構成銘柄の異動、③ 現物株式ポートフォリオの調整の場合

- ✓ 目標追加売買金額を0として、①と同様の方法で各銘柄の売買株数を算出する。ただし、期日が売買不可日となる銘柄の売買株数は0とする。
- ✓ 当該売買反映後の現物株式の組入比率を計算した結果、組入比率が閾値を超過する場合は、①の方法で算出する。

③ キャッシュ残高の赤残（資金不足）が見込まれる場合

- ✓ 現物時価総額に目標売却金額（算出方法は（1）④を参照）を減じた金額に、Solactive Japan Semiconductor Opportunistic Index（配当込み）に採用されている各銘柄の構成ウェイトを掛けることで、銘柄毎の目標の保有金額・保有株数を算出する。
- ✓ 上記銘柄毎の目標の保有株数に対し、実際ファンドで保有する株数との過不足株数を計算し、過不足分のある銘柄について売買を行う。ただし、期日が売買不可日となる銘柄の売買株数は0とする。

<改訂日>

2025年9月25日