

【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】 平成29年12月28日

【発行者名】 BNPパリバ・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 島崎 亮平

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
グラントウキョウノースタワー

【事務連絡者氏名】 入山 小枝子

【電話番号】 03-6377-2882

【届出の対象とした募集（売出）ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・  
内国投資信託受益証券に係るファ為替ヘッジあり（SMA専用）  
ンドの名称】

【届出の対象とした募集（売出）1,000億円を上限とします。  
内国投資信託受益証券の金額】

【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】

平成29年11月15日付をもって提出した有価証券届出書（平成29年12月1日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書にて訂正。）について、信託報酬率の引下げに伴う変更、及び記載事項の一部に訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書を提出するものです。

## 【訂正の内容】

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】

ファンドの特色

<訂正前>

(略)

- (i) 「HFRI総合指数<sup>®</sup>(HFRI Weighted Composite Index<sup>®</sup>)」(以下「HFR指数」)は、ヘッジ・ファンド・リサーチ・インク(HFR)の商標であり、「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(SMA専用)」に関する使用のみ、BNPパリバ・インベストメント・パートナーズ株式会社に許諾されています。この使用許諾以外に、HFR及びHFR指数(当該指数は当該投資信託と独立し、関係なく算出されている)は、当該投資信託と関係はなく、当該投資信託の設定、投資判断や他の事務や販売に関与しておらず、又は関与する予定はありません。HFRは、当該投資信託を発起、支持、販売又は推奨していません。HFRIは、当該投資信託あるいは当該投資信託への投資に関する妥当性や、HFR指数の使用に起因して当該投資信託が得た結果即ちある特定の日に於ける当該投資信託の運用成績がHFR指数の運用成績あるいはHFR指数の価値に追従するかどうかを含む運用成績について明示的あるいは暗示的な推奨、保証又は表明をしていません。HFRは当該投資信託や当該投資信託の投資家に対してHFR指数の過誤について通知する義務を負いません。HFRIは、HFR指数の計算に使用される方法を含むHFR指数をいつでも修正、変更し、HFR指数の計算、公表そして周知を停止する権利を有します。これは、HFR指数に基づく有価証券の売買の申込み又は申込みの勧誘ではありません。

(以下略)

<訂正後>

(略)

- (i) 「HFRI総合指数<sup>®</sup>(HFRI Weighted Composite Index<sup>®</sup>)」(以下「HFR指数」)は、ヘッジ・ファンド・リサーチ・インク(HFR)の商標であり、「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(SMA専用)」に関する使用のみ、BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社に許諾されています。この使用許諾以外に、HFR及びHFR指数(当該指数は当該投資信託と独立し、関係なく算出されている)は、当該投資信託と関係はなく、当該投資信託の設定、投資判断や他の事務や販売に関与しておらず、又は関与する予定はありません。HFRは、当該投資信託を発起、支持、販売又は推奨していません。HFRIは、当該投資信託あるいは当該投資信託への投資に関する妥当性や、HFR指数の使用に起因して当該投資信託が得た結果即ちある特定の日に於ける当該投資信託の運用成績がHFR指数の運用成績あるいはHFR指数の価値に追従するかどうかを含む運用成績について明示的あるいは暗示的な推奨、保証又は表明をしていません。HFRは当該投資信託や当該投資信託の投資家に対してHFR指数の過誤について通知する義務を負いません。HFRIは、HFR指数の計算に使用される方法を含むHFR指数をいつでも修正、変更し、HFR指数の計算、公表そして周知を停止する権利を有します。これは、HFR指数に基づく有価証券の売買の申込み又は申込みの勧誘ではありません。

(以下略)

## 4【手数料等及び税金】

## (3)【信託報酬等】

<訂正前>

信託報酬の総額は、信託約款に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.2636%（税抜1.17%）の率を乗じて得た額とします。信託報酬の配分は以下の通りです。

信託報酬の総額		純資産総額に対して年率 1.2636%（税抜 1.17%）	
配分	委託会社	年率 0.918%（税抜 0.85%）	委託した資金の運用の対価
	販売会社	年率 0.27%（税抜 0.25%）	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	年率 0.0756%（税抜 0.07%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(以下略)

<訂正後>

信託報酬の総額は、信託約款に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.8532%（税抜0.79%）以内の率を乗じて得た額とします。

平成29年12月28日現在、信託報酬の配分は以下の通りです。

信託報酬の総額		純資産総額に対して年率 0.8532%（税抜 0.79%）	
配分	委託会社	年率 0.5832%（税抜 0.54%）	委託した資金の運用の対価
	販売会社	年率 0.216%（税抜 0.20%）	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	年率 0.054%（税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

（以下略）

## 信託約款

平成29年12月28日付で、下記の通り信託約款を変更いたします。

（下線部\_\_\_\_\_は変更箇所を示します。）

### ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（SMA専用）

変更後	変更前
<p><b>【信託報酬の額及び支弁の方法】</b></p> <p>第41条 委託者及び受託者の信託報酬の総額は、第38条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の79以内の率(税抜き)を乗じて得た額とします。なお、委託者と受託者との間の配分は、別に定めます。</p> <p>② (略)</p> <p>③ (略)</p>	<p><b>【信託報酬の額及び支弁の方法】</b></p> <p>第41条 委託者及び受託者の信託報酬の総額は、第38条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の117の率(税抜き)を乗じて得た額とします。なお、委託者と受託者との間の配分は、別に定めます。</p> <p>② (略)</p> <p>③ (略)</p>