

【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】 | 2020年12月1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】 | 中村 慎吾 |
| 【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グローバルESGバランス・ファンド（為替ヘッジあり） SBIグローバルESGバランス・ファンド（為替ヘッジなし） |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】 | 各ファンドにつき、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】

2020年8月28日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」という。）について、本ファンドが投資対象とする投資信託証券を新たに選定し信託約款の付表に追加すると同時に、当該投資信託証券への入れ替えを行うこととしたため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

下線部_____が訂正箇所です。

原届出書の該当箇所については、それぞれ下記の内容に訂正されます。

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>

(略)

ファンドの特色

(略)



実質基本投資割合は、株式50%、債券50%を基準として±10%の範囲を原則とします。

- 市況変動等により想定する配分比率から大きく乖離した場合は、適時、基本投資割合に準じた構成比率に戻す調整を行います。
- 経済環境の変化等が見込まれた場合には、基本投資割合を見直す場合があります。



※上図はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※急激な値動きがあった場合等には、基本投資割合と大きく異なる場合があります。

- ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行い、株式部分を「LOファンズ-グローバル・リスポンシブル・エクイティ」、債券部分を「LOファンズ-グローバル・クライメイト・ボンド」に投資します。投資信託証券の合計組入比率は原則として高位を保ちます。

※投資対象とする投資信託証券は、委託会社の判断により変更する場合があります。投資信託証券の選定にあたっては、運用プロセスのESGに関する定義・投資判断の基準や運用状況等を総合的に勘案の上、決定します。

* 投資対象とする投資信託証券の概要につきましては、後掲「2 投資方針 (2) 投資対象 <参考情報> 投資対象とする投資信託証券の概要」をご参照ください。

(略)

運用プロセス <株式>

- 投資対象とする外国投資信託の運用は、ロンバー・オディエ・アセット・マネジメント(スイス) エス・エーが行います。
- ロンバー・オディエ独自の株式銘柄選定手法である**CAR**を従来の**ESG**に組合わせ、複数の側面から銘柄の分析を行います。

CARとは？

ロンバー・オディエ独自の株式銘柄選定手法です。E(環境)S(社会)G(ガバナンス)それぞれの問題に対して、企業がどのような問題意識(Consciousness)を持っているのか、その問題を解決するためにどのような行動(Action)を行い、どのような結果(Results)をだしているのかを分析する考え方です。

【LOファンズ - グローバル・リスポンシブル・エクイティの運用プロセス イメージ図】



*上記運用プロセスは本書作成日現在のものです。今後変更になる可能性があります。

(略)

<訂正後>

(略)

ファンドの特色

(略)



実質基本投資割合は、株式50%、債券50%を基準として±10%の範囲を原則とします。

- 市況変動等により想定する配分比率から大きく乖離した場合は、適時、基本投資割合に準じた構成比率に戻す調整を行います。
- 経済環境の変化等が見込まれた場合には、基本投資割合を見直す場合があります。



*上図はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

*急激な値動きがあった場合等には、基本投資割合と大きく異なる場合があります。

- ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行い、株式部分を「LOファンズ-クライメイト・トランジション[※]」、債券部分を「LOファンズ-グローバル・クライメイト・ボンド」に投資します。投資信託証券の合計組入比率は原則として高位を保ちます。

※当該ファンド設定後、従前の「LOファンズ-グローバル・リスポンシブル・エクイティ」から入れ替えを行います。

*投資対象とする投資信託証券は、委託会社の判断により変更する場合があります。投資信託証券の選定にあたっては、運用プロセスのESGに関する定義・投資判断の基準や運用状況等を総合的に勘案の上、決定します。

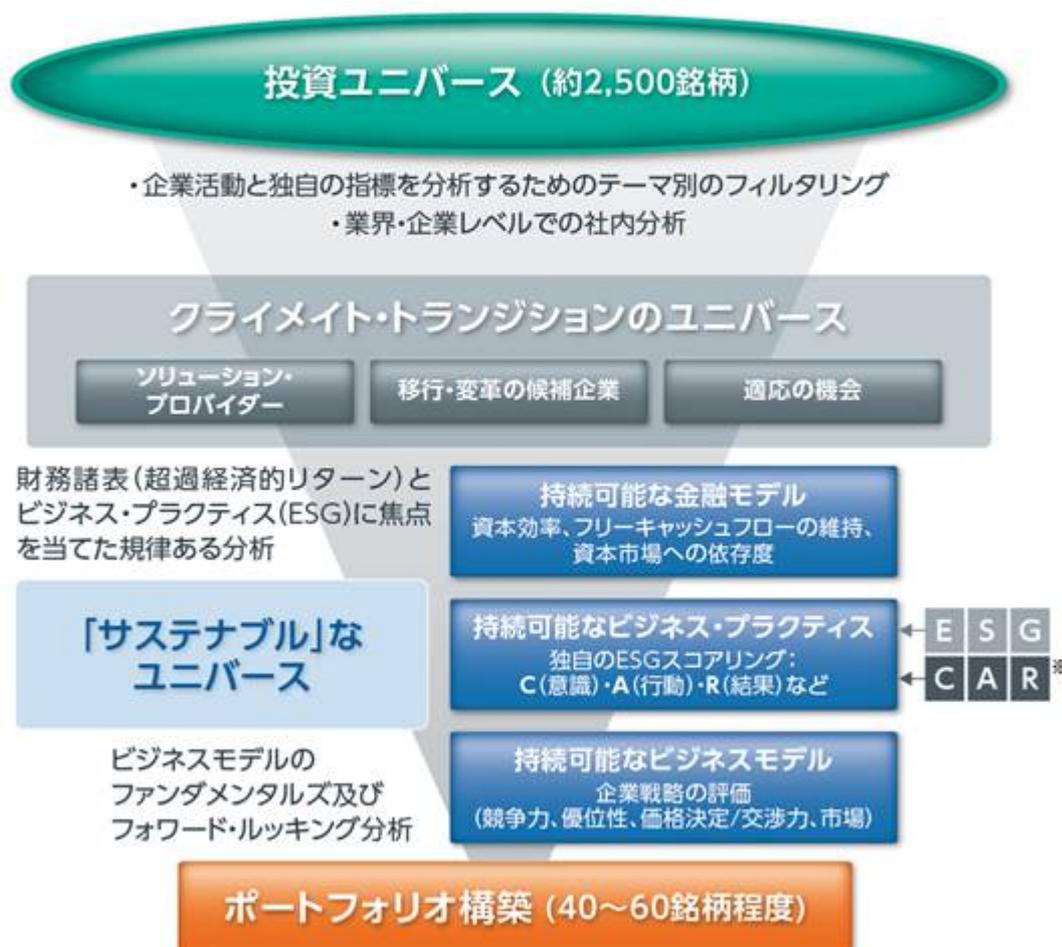
- * 投資対象とする投資信託証券の概要につきましては、後掲「2 投資方針 (2) 投資対象 < 参考情報 > 投資対象とする投資信託証券の概要」をご参照ください。

(略)

運用プロセス <株式>

- 投資対象とする外国投資信託の運用は、ロンバー・オディエ・アセット・マネジメント（ヨーロッパ）リミテッドが行います。
- ロンバー・オディエ独自の株式銘柄選定手法であるCARを従来のESGに組み合わせ、複数の側面から銘柄の分析を行います。

【LOファンズ - クライメイト・トランジションの運用プロセス イメージ図】



※[CAR]とは、ロンバー・オディエ独自の株式銘柄選定手法で、E（環境）、S（社会）、G（ガバナンス）それぞれの問題に対して、企業がどのような問題意識（Consciousness）を持ち、その解決のためにどのような行動（Action）を行い、どのような結果（Results）をだしているのかを分析する考え方です。

*上記運用プロセスは2020年12月1日現在のものです。今後変更になる可能性があります。

（略）

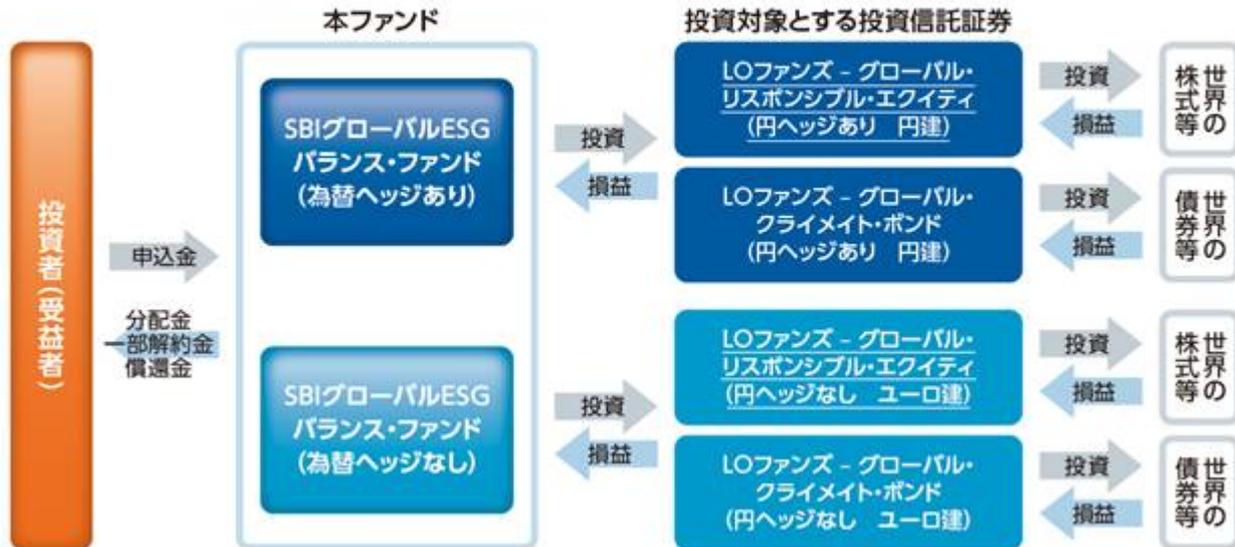
(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

ファンドの仕組み

本ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。

ファンド・オブ・ファンズ方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金を複数の投資信託に投資することにより運用を行う方式です。



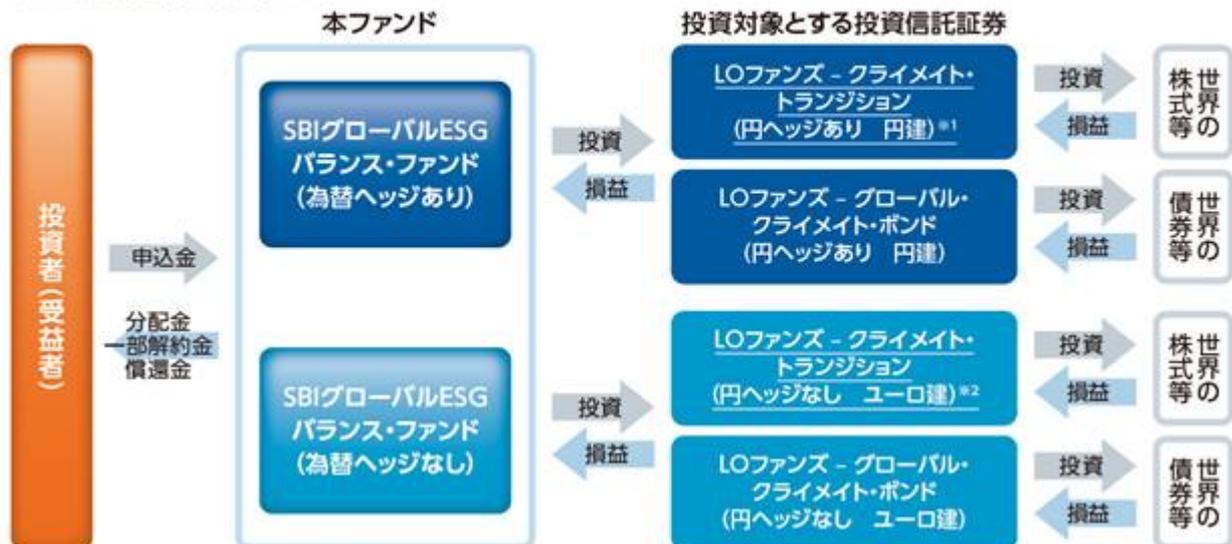
(略)

<訂正後>

ファンドの仕組み

本ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。

ファンド・オブ・ファンズ方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金を複数の投資信託に投資することにより運用を行う方式です。



※1 [LOファンズ - グローバル・リスポンシブル・エクイティ(円ヘッジあり 円建)]から入れ替えを行います。

※2 [LOファンズ - グローバル・リスポンシブル・エクイティ(円ヘッジなし ユーロ建)]から入れ替えを行います。

(略)

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<訂正前>

（略）

投資態度

（為替ヘッジあり）

- （ ）主として、「L0ファンズ - グローバル・リスポンシブル・エクイティ（円ヘッジあり 円建）」及び「L0ファンズ - グローバル・クライメイト・ボンド（円ヘッジあり 円建）」への投資を通じて、世界の株式及び債券等（社債、政府保証債、政府機関債、国際機関債等）に投資を行います。ただし、投資する投資信託証券は、委託会社の判断により変更する場合があります。その際、既投資の投資信託証券が投資対象から外れたり、新たな投資信託証券を投資対象に追加する場合があります。なお、投資信託証券の選定にあたっては、運用プロセスのESGに関する定義・投資判断の基準や運用状況等を総合的に勘案の上、決定します。

（略）

（為替ヘッジなし）

- （ ）主として、「L0ファンズ - グローバル・リスポンシブル・エクイティ（円ヘッジなし ユーロ建）」及び「L0ファンズ - グローバル・クライメイト・ボンド（円ヘッジなし ユーロ建）」への投資を通じて、世界の株式及び債券等（社債、政府保証債、政府機関債、国際機関債等）に投資を行います。ただし、投資する投資信託証券は、委託会社の判断により変更する場合があります。その際、既投資の投資信託証券が投資対象から外れたり、新たな投資信託証券を投資対象に追加する場合があります。なお、投資信託証券の選定にあたっては、運用プロセスのESGに関する定義・投資判断の基準や運用状況等を総合的に勘案の上、決定します。

（略）

<訂正後>

（略）

投資態度

（為替ヘッジあり）

（ ）主として、「L0ファンズ - クライメイト・トランジション（円ヘッジあり 円建）」及び「L0ファンズ - グローバル・クライメイト・ボンド（円ヘッジあり 円建）」への投資を通じて、世界の株式及び債券等（社債、政府保証債、政府機関債、国際機関債等）に投資を行います。ただし、投資する投資信託証券は、委託会社の判断により変更する場合があります。その際、既投資の投資信託証券が投資対象から外れたり、新たな投資信託証券を投資対象に追加する場合があります。なお、投資信託証券の選定にあたっては、運用プロセスのESGに関する定義・投資判断の基準や運用状況等を総合的に勘案の上、決定します。

（略）

（為替ヘッジなし）

（ ）主として、「L0ファンズ - クライメイト・トランジション（円ヘッジなし ユーロ建）」及び「L0ファンズ - グローバル・クライメイト・ボンド（円ヘッジなし ユーロ建）」への投資を通じて、世界の株式及び債券等（社債、政府保証債、政府機関債、国際機関債等）に投資を行います。ただし、投資する投資信託証券は、委託会社の判断により変更する場合があります。その際、既投資の投資信託証券が投資対象から外れたり、新たな投資信託証券を投資対象に追加する場合があります。なお、投資信託証券の選定にあたっては、運用プロセスのESGに関する定義・投資判断の基準や運用状況等を総合的に勘案の上、決定します。

（略）

(2)【投資対象】

<参考情報>につきましては、以下の内容に訂正・更新します。

■投資対象とする投資信託証券の概要

■(為替ヘッジあり)

LOファンズ - クライメイト・トランジション(円ヘッジあり 円建)

■(為替ヘッジなし)

LOファンズ - クライメイト・トランジション(円ヘッジなし ユーロ建)

| | |
|---------|--|
| 形態 | ルクセンブルク籍外国投資法人 |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none"> 主として気候変動に適応・対応した世界各国の企業の株式等に投資し、中長期的な信託財産の成長を目指します。 銘柄の選定にあたってはESGの観点を加味します。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> 純資産総額の75%以上を世界各国の株式等に投資します。 同一企業の発行する株式等への投資割合は純資産総額の10%以内とします。 中国本土企業が発行する株式(中国A株を含みます)の投資割合は、原則として純資産総額の20%以内とします。 純資産総額の10%を超える借入れは行いません。 デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 |
| 参考指数 | MSCIワールド・インデックス(ネット・トータル・リターン) |
| 設定日 | 2020年12月2日(予定) |
| 決算日 | 年1回決算(毎年9月30日) |
| 信託報酬等 | <p>年率0.50%</p> <p>このほか管理事務代行報酬、保管報酬等がファンドの信託財産から負担されます。これらは定率ではないために事前に料率等を表示することができません。</p> |
| その他の費用 | <p>ファンドの設定・開示に関する費用(監査報酬、弁護士報酬等)、組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等がかかります。</p> |
| 信託財産留保額 | ありません。 |
| 投資顧問会社 | ロンパー・オディエ・アセット・マネジメント(ヨーロッパ)リミテッド |
| 管理会社 | ロンパー・オディエ・ファンズ(ヨーロッパ)エス・エー |

*上記は、2020年12月1日以降に投資する投資信託証券の内容です。今後変更になる場合があります。

■(為替ヘッジあり)

LOファンズ - グローバル・クライメイト・ボンド(円ヘッジあり 円建)

■(為替ヘッジなし)

LOファンズ - グローバル・クライメイト・ボンド(円ヘッジなし ユーロ建)

| | |
|---------|---|
| 形態 | ルクセンブルク籍外国投資法人 |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の債券等に投資します。 ・気候変動の抑制/適応への貢献及びソーシャル・インパクトがあると考えられる債券を厳選し、インカム収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目指します。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・同一企業の発行する債券等への投資割合は純資産総額の10%以内とします。 ・BBB-未満の債券への投資は純資産総額の10%以内とします。 ・純資産総額の10%を超える借入れは行いません。 ・デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 |
| 参考指数 | ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合インデックス |
| 設定日 | (円ヘッジあり 円建) 2017年7月17日 (円ヘッジなし ユーロ建) 2019年6月3日 |
| 決算日 | 年1回決算(毎年9月30日) |
| 信託報酬等 | 年率0.40% このほか管理事務代行報酬、保管報酬等がファンドの信託財産から負担されます。これらは定率ではないために事前に料率等を表示することができません。 |
| その他の費用 | ファンドの設定・開示に関する費用(監査報酬、弁護士報酬等)、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等がかかります。 |
| 信託財産留保額 | ありません。 |
| 投資顧問会社 | ロンパー・オディエ・アセット・マネジメント(ヨーロッパ)リミテッド アフーマティブ・インベストメント・マネジメント・パートナーズ・リミテッド(AIM) |
| 管理会社 | ロンパー・オディエ・ファンズ(ヨーロッパ)エス・エー |

*上記は、本書作成日現在のものであり、今後変更になる場合があります。