



NISSAY
ASSET MANAGEMENT

News Release

ニッセイアセットマネジメント株式会社

2024年8月2日

ニッセイ・円建てグローバル社債／バランスファンド2024-09

愛称：まもるとふやす

の設定について

ニッセイアセットマネジメント株式会社（社長：大関 洋）は、単位型の株式投資信託「ニッセイ・円建てグローバル社債／バランスファンド2024-09 愛称：まもるとふやす」の設定・運用開始を2024年9月30日に予定しています。

当ファンドは、コンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドが発行する円建て債券に投資し、信託財産の成長を図ることを目標に運用を行います。

商 品 名：ニッセイ・円建てグローバル社債／バランスファンド2024-09
愛称：まもるとふやす

商 品 分 類：単位型投信／海外／資産複合／特殊型（条件付運用型）

購入の申込期間：2024年8月19日から2024年9月27日まで

- 2024年9月28日以降は、購入の申込みの受付を行いません。

設 定 日：2024年9月30日

取扱販売会社：あかつき証券株式会社、香川証券株式会社

■ ファンドの特色

- 当ファンドは、複数の外貨建て投資適格社債を裏付けとして円建てで発行される債券（以下「円建て債券」といいます）へ高位に投資し、約5年後の満期まで保有します。信託期間終了時の元本確保をめざすと同時に、実質的に複数の資産に分散投資をすることで高いリターンを獲得をめざします。

<当ファンドがめざす元本確保について>

- 当ファンドは約5年後の信託期間終了時における元本確保をめざしますが、それを保証するものではありません。元本は購入時手数料を考慮しません。
- 以下のような場合には、お客様が受取る金額が元本を下回ることがあります。
 - ・ 円建て債券の裏付け資産となる投資適格社債が債務不履行となった場合
 - ・ 信託期間中に当ファンドを換金した場合
 - ・ 当ファンドが繰上償還された場合 等

ファンドは、特化型運用を行います。特化型運用ファンドとは、投資対象に一般社団法人投資信託協会規則に定める寄与度が10%を超える支配的な銘柄が存在、または存在することとなる可能性が高いファンドをいいます。ファンドが実質的な投資対象とする外貨建て投資適格社債には、寄与度が10%を超える、または超える可能性の高い支配的な銘柄が存在するため、特定の銘柄への投資が集中することがあり、当該銘柄の発行体等に経営破綻や経営・財務状況の悪化などが生じた場合には、大きな損失が発生することがあります。

この件に関するお問い合わせは

広報室

〒100-8219 東京都千代田区丸の内1-6-6 日本生命丸の内ビル

Tel.03-5533-4037

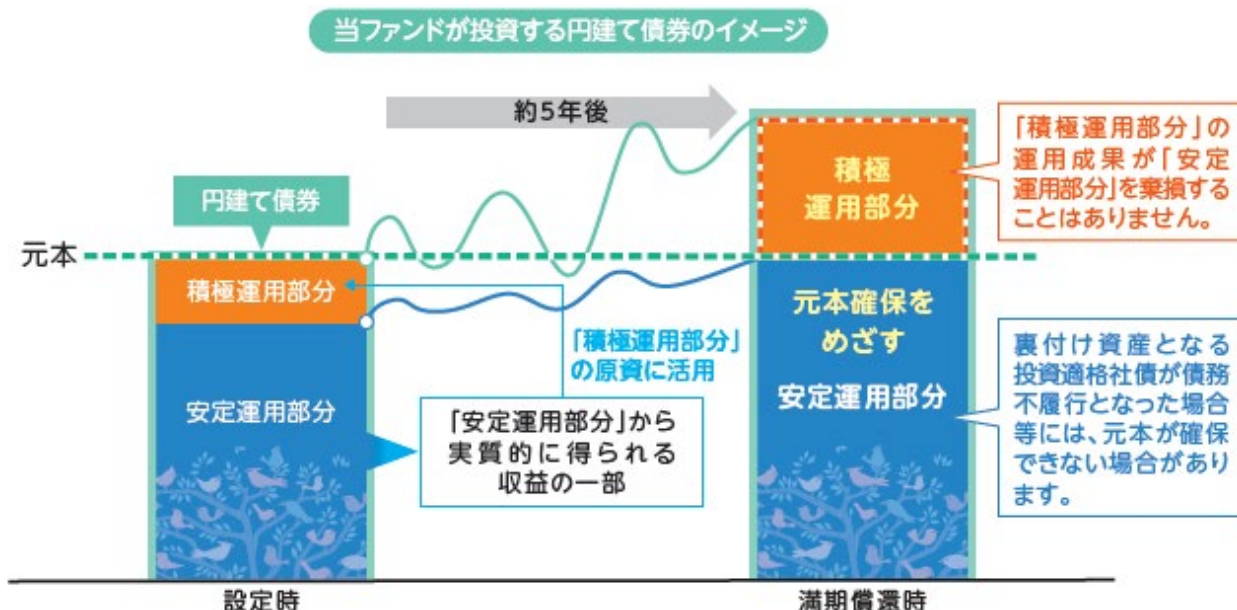
<https://www.nam.co.jp/>

ひたむきにその先を見つめ、より良い未来へつなぐ

— A Good Investment for the Future —



- 円建て債券の運用成果は、元本確保をめざす「安定運用部分」と高いリターンの獲得をめざす「積極運用部分」で構成されています。



❶ 「安定運用部分」「積極運用部分」の割合は、当ファンド設定時における投資適格社債の利回り等によって決定されます。信託期間中に当ファンドを換金した場合や当ファンドが繰上償還された場合等には、お客様が受取る金額が元本を下回る場合があります。

- 「安定運用部分」は、ニッセイアセットマネジメントが銘柄選定した期間約5年の外貨建て投資適格社債に分散投資し、実質的に為替ヘッジ(対円)され、投資適格社債の満期まで保有することによって元本確保をめざします。

- 裏付けとする投資適格社債が格下げされた場合でも、原則として信託期間中の銘柄入替は行いません。

- 「積極運用部分」は、「安定運用部分」から実質的に得られる収益(利金、償還差損益)の一部を活用しシティグループが算出する合成指数※に投資を行い、高いリターンの獲得をめざします。なお、「積極運用部分」の運用成果が「安定運用部分」を棄損することはありません。

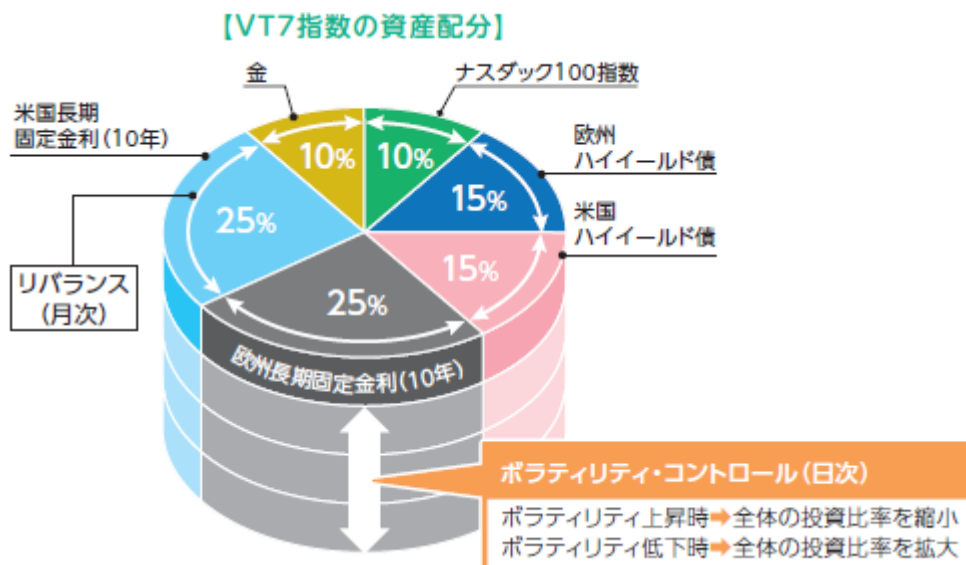
※合成指数はスタティックマルチアセットS2 VT7指数(以下「VT7指数」ということがあります)です。

- 「積極運用部分」については、投資対象資産のパフォーマンスを受取る契約をシティグループのロンドン法人であるシティグループ・グローバル・マーケット・リミテッドと締結することにより、投資対象資産を保有することなく実質的に投資を行っていることと同等の投資効果を楽しむことができます。
- 「積極運用部分」の日々の値動きは、VT7指数の日次騰落率の原則12倍程度となるように運用します。ただし、「積極運用部分」の評価額が積極運用開始時から一定程度※上昇した場合においては、倍率が12倍程度から引下げられます。なお、当ファンドの日々の値動きがVT7指数の日次騰落率の12倍となるわけではありません。
- VT7指数が一日で一定程度※下落した場合は、「積極運用部分」の評価額はゼロとなり、信託期間終了時まで円建て債券は「安定運用部分」のみでの運用となります。

※各々の「一定程度」の水準については、運用状況等により変動するため事前に記載することはできません。

- VT7指数は、6つの資産で構成されます(比率は固定、月一回のリバランス)。年率ボラティリティが7%になることをめざして、全体の投資比率を調整します。

❶ ボラティリティは資産価格の変動の度合いを示す指標で、上昇すると価格の変動率が大きくなり、低下すると価格の変動率が小さくなります。年率7%はボラティリティ水準の目標値であり、常に水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれも保証するものではありません。また、年率7%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。



上記はボラティリティ・コントロールを表したイメージ図であり、すべての特徴を網羅したものではありません。

米国長期固定金利(10年)：米ドル10年金利スワップトラッカーインデックス、欧州長期固定金利(10年)：ユーロ10年金利スワップトラッカーインデックス、米国ハイイールド債：米国ハイイールド債5年物指数イントラディマーケットトラッカーシリーズ2インデックス、欧州ハイイールド債：欧州ハイイールド債5年物指数イントラディマーケットトラッカーシリーズ2インデックス、ナスダック100指数：米国大型テクノロジー株式トラッカーシリーズ1インデックス、金：コモディティ・ベンチマーク・MONOインデックス・ゴールド

VT7指数は各資産の構成比率とそれぞれの収益率などを合成し、VT7指数の維持・管理および「積極運用部分」が「安定運用部分」を棄損させないための費用としてVT7指数の日次収益率に対し年率1.5%を控除して算出されます。また、VT7指数内における取引等の費用がかかりますが、当該費用は運用状況等により変動するため、事前に料率・上限額等を記載することはできません。

円建て債券の概要

発行形態	ユーロ円債
発行体	コンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッド
償還期間	約5年
発行価格	100
償還価格	「安定運用部分」と「積極運用部分」を合わせた価格

シティグループのご紹介

シティグループは、国際取引を必要とするお客様のための卓越した金融パートナー、ウェルス・マネジメント分野のグローバルリーダーであり、米国市場で高く評価されているパーソナル・バンキング事業を展開している金融機関です。世界約160の国と地域において、個人、法人、政府機関などのお客様に幅広い金融商品とサービスを提供しています。100年以上前に日本に参入し、以来、政府機関、金融機関、事業法人、機関投資家など、日本のお客様のあらゆるファイナンスのニーズにお応えしています。

コンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドのご紹介

コンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドは、債券を発行することを主な業務とする特別目的事業体です。

・ シティグループおよびコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドの免責条項

シティは、世界中で使用・登録されているシティグループ・インクまたはその関連会社の登録商標およびサービスマークです。「ニッセイ・円建てグローバル社債／バランスファンド2024-09」(以下「本商品」といいます)は、シティグループまたはコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドによって支援、承認、販売または促進されておらず、またシティグループおよびコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドは、本商品に対して投資することの推奨性について、一切の表明を行っていません。シティグループおよびコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドは、商品性および特定の目的または使用に関する適合性の保証を含む(ただし、これらに限られない)一切の明示または黙示の保証を行っていません。いかなる場合であっても、シティグループおよびコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドは、シティグループまたはコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドのデータおよび情報の使用に関連して、直接損害、間接損害、特別損害または派生的損害に対して、一切責任を負いません。

● 年1回決算を行います。信託財産の十分な成長に資することに配慮し、分配を抑制する方針です。

- ・ 毎年9月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。
- ・ 初回決算日は、2025年9月25日とします。

❗ 将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

■ お申込みメモ

購入価額	1口当たり1円とします。
換金価額	換金申込受付日の翌々営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた額とします。
換金代金	換金申込受付日から起算して、原則として8営業日目からお支払いします。
申込締切時間	換金については、原則として毎営業日の午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。 ● 換金にかかる申込締切時間は2024年11月5日から「午後3時30分」までとする予定です。ただし、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。
申込不可日	換金申込受付日が次のいずれかと同日の場合は、申込みの受け付けを行いません。 ・換金申込受付日の翌営業日が円建て債券の買取申込不可日 ・換金申込受付日の翌々営業日がロンドンの銀行休業日 ・換金代金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日
購入の申込期間	2024年8月19日から2024年9月27日まで ● 2024年9月28日以降は、購入の申込みの受け付けを行いません。
信託期間	2029年9月25日まで(設定日：2024年9月30日)
繰上償還	・投資対象とするコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドが発行する円建て債券が存続しないこととなる場合には、ファンドを繰上償還します。 ・受益権の口数が50億口または純資産総額が50億円を下回っている場合、シティグループが算出するスタンティックマルチアセットS2 VT7指数に重大な変更が生じるまたは算出・公表が停止された場合等には、委託会社はあらかじめ受益者に書面により通知する等の手続きを経て、ファンドを繰上償還させることがあります。
決算日	9月25日(該当日が休業日の場合は翌営業日) ● 初回決算日は、2025年9月25日とします。
課税関係	課税上は株式投資信託として取扱われます。公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA(少額投資非課税制度)の対象となりますが、当ファンドは、NISAの対象ではありません。

■ ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用		
購入時	購入時手数料	購入価額(1口当たり1円)に 3.3%(税抜3.0%) を上限として販売会社が独自に定める率をかけた額とします。 ●詳しくは販売会社にお問合せください。
換金時	信託財産留保額	換金申込受付日の翌々営業日の基準価額に 0.3% をかけた額とします。
投資者が信託財産で間接的に負担する費用		
毎日	運用管理費用(信託報酬)	ファンドの元本総額に 年率0.902%(税抜0.82%) をかけた額とし、ファンドからご負担いただきます。
	監査費用	ファンドの元本総額に年率0.011%(税抜0.01%)をかけた額を上限とし、ファンドからご負担いただきます。
随時	その他の費用・手数料	<ul style="list-style-type: none"> ・ファンドが投資対象とする円建て債券の発行時に、100,000米ドル程度の費用がかかります。また、VT7指数の維持・管理および「積極運用部分」が「安定運用部分」を棄損させないための費用として、毎日、VT7指数の日次収益率に対し年率1.5%が控除されます。その他、VT7指数内における取引等の費用がかかりますが、当該費用は運用状況等により変動するため、事前に料率・上限額等を記載することはできません。なお、当該債券の価格は、これらの費用を控除したのちに算出されます。 ・有価証券の売買委託手数料、信託事務の諸費用および借入金の利息等はファンドからご負担いただきます。これらの費用は運用状況等により変動するため、事前に料率・上限額等を記載することはできません。

❗ 当該費用の合計額、その上限額および計算方法は、運用状況および受益者の保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

■投資リスク

- 当ファンドは、複数の外貨建て投資適格社債を裏付けとする円建てで発行される債券を投資対象とし、当該債券の運用成果は投資元本(購入時手数料を考慮しません)の確保をめざす「安定運用部分」とレバレッジ取引を活用して高いリターンを獲得をめざす「積極運用部分」で構成されます。「安定運用部分」は、投資適格社債に投資するため、金利変動等による組入社債の価格の下落、組入社債の発行体の倒産や財務状況の悪化等により社債の価格は下落することがあります。「積極運用部分」は、複数の資産で構成される合成指数に投資するため、指数の実質的な構成対象国・地域の経済情勢、資本規制、税制また取引規制等により指数は下落することがあります。これらの要因により、ファンドの基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、これらに加え、為替の変動により損失を被ることがあります。
- **ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果(損益)はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。**
- 当ファンドの基準価額の主な変動要因としては、「安定運用部分に関するリスク(「債券投資リスク」「為替変動リスク)」、「積極運用部分に関するリスク(「価格変動リスク」「レバレッジリスク」「戦略リスク)」、「繰上償還リスク」、「流動性リスク」などがあります。

■ご留意いただきたい事項

- 投資信託はリスクを含む商品であり、運用実績は市場環境等により変動し、運用成果(損益)はすべて投資者の皆様のものとなります。投資元本および利回りが保証された商品ではありません。
- 当資料はニッセイアセットマネジメントが作成したものです。ご購入に際しては、販売会社よりお渡しする投資信託説明書(交付目論見書)、契約締結前交付書面等(目論見書補完書面を含む)の内容を十分にお読みになり、ご自身でご判断ください。
- 投資信託は保険契約や金融機関の預金ではなく、保険契約者保護機構、預金保険の対象とはなりません。証券会社以外の金融機関で購入された投資信託は、投資者保護基金の支払対象にはなりません。