



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1月31日

ニッセイ/シュローダー好利回りCBファンド 2024-03(為替ヘッジあり・限定追加型) 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、追加型の株式投資信託「ニッセイ/シュローダー好利回りCBファンド2024-03(為替ヘッジあり・限定追加型)」の設定・運用開始を2024年3月18日に予定しています。

当ファンドは、投資対象とする指定投資信託証券を通じて、日本を含む世界のCB(転換社債)を実質的な主要投資対象とし、安定したインカムゲインの確保および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/シュローダー好利回りCBファンド2024-03(為替ヘッジあり・限定追加型)
商品分類：追加型投信／内外／その他資産(転換社債)
当初申込期間：2024年2月16日(金)～2024年3月15日(金)
継続申込期間：2024年3月18日(月)～2024年4月19日(金)
設定日：2024年3月18日(月)
取扱販売会社：大熊本証券株式会社、株式会社関西みらい銀行

当ファンドの特色

① 日本を含む世界のCB(転換社債)に投資します。

- 「CB(転換社債)」とは、一定の条件で株式に転換できる権利(転換権)のついた債券です。
- 「シュローダー先進国好利回りCBファンド2024-03(適格機関投資家専用)」および「ニッセイマネーストックマザーファンド」を投資対象とするファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。CBの実質的な運用はシュローダーが行います。
- 「シュローダー先進国好利回りCBファンド2024-03(適格機関投資家専用)」の組入比率は、原則として高位を保ちます。

② 信託期間を勘案しつつ、相対的に利回りが高いと判断される銘柄に投資します。

- 原則としてファンドの信託期間(約5年)内に償還日を迎えるCBに投資し、償還日まで保有することを基本とします。
- CBの償還金等は、原則として信託期間内に償還日を迎えるCBに再投資します。
- 利回りに加え、発行体の信用リスク、流動性などを勘案して、組入銘柄および組入比率を決定します。
なお、信用格付が投資適格未滿(BB格相当以下)の銘柄も積極的に組入れます。

③ 外貨建資産について、原則として対円での為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図ります。

- 原則としてファンドの信託期間(約5年)に応じた長期間の為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減に加え為替ヘッジコストの変動リスクの抑制をめざします。
 - ・円の金利が為替ヘッジを行う当該外貨の金利より低い場合などには、ヘッジコストが発生することがあります。
 - ・長期間の為替ヘッジにより、為替変動リスクおよび為替ヘッジコストの変動リスクを完全に排除できるものではありません。
また、金利等の変動により為替ヘッジにかかる評価損益が変動し、基準価額を変動させる要因となります。

④ 信託期間約5年の限定追加型の投資信託です。

- 信託期間は、2024年3月18日から2029年3月12日までです。
- 購入の申込みは、2024年4月19日までの間に限定して受け付けます。

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。



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/>

■ 商品概要

購入単位	販売会社が定める単位とします。				
購入価額	①当初申込期間：1口当り1円とします。 ②継続申込期間：購入申込受付日の翌営業日の基準価額とします。 ●収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。				
換金価額	換金申込受付日の翌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7営業日目からお支払いします。				
申込締切時間	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。				
購入の申込期間	①当初申込期間：2024年2月16日(金)～2024年3月15日(金) ②継続申込期間：2024年3月18日(月)～2024年4月19日(金) ●2024年4月20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3月12日まで(設定日：2024年3月18日)				
繰上償還	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	3月10日(該当日が休業日の場合は翌営業日) ●初回決算日は、2025年3月10日とします。				
受託会社	株式会社りそな銀行				
投資者が直接的に負担する費用					
購入時	購入時手数料	購入申込受付日の翌営業日の基準価額(当初申込期間：1口当り1円)に 2.2%(税抜2.0%) 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。 ●料率は変更となる場合があります。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営業日の基準価額に 0.5% 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)	ファンドの純資産総額に年率0.627%(税抜0.57%)をかけた額とし、ファンドからご負担いただきます。			
		<table border="1"> <tr> <td>投資対象とする指定投資信託証券</td> <td>シュローダー先進国好利回りC Bファンド2024-03(適格機関投資家専用)：年率0.5225%(税抜0.475%) ニッセイマネーストックマザーファンド：ありません。</td> </tr> <tr> <td>実質的な負担</td> <td>ファンドの純資産総額に年率1.1495%(税抜1.045%)程度をかけた額となります。 ●上記は目安であり、各指定投資信託証券への投資比率が変動することにより、投資者が負担する実質的な運用管理費用(信託報酬)は変動します。</td> </tr> </table>	投資対象とする指定投資信託証券	シュローダー先進国好利回りC Bファンド2024-03(適格機関投資家専用)：年率0.5225%(税抜0.475%) ニッセイマネーストックマザーファンド：ありません。	実質的な負担
	投資対象とする指定投資信託証券	シュローダー先進国好利回りC Bファンド2024-03(適格機関投資家専用)：年率0.5225%(税抜0.475%) ニッセイマネーストックマザーファンド：ありません。			
実質的な負担	ファンドの純資産総額に 年率1.1495%(税抜1.045%)程度 をかけた額となります。 ●上記は目安であり、各指定投資信託証券への投資比率が変動することにより、投資者が負担する実質的な運用管理費用(信託報酬)は変動します。				
監査費用	ファンドの純資産総額に年率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	組入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。また、ファンドが「シュローダー先進国好利回りC Bファンド2024-03(適格機関投資家専用)」を換金する際には、信託財産留保額※をファンドからご負担いただきます。 ※ シュローダー先進国好利回りC Bファンド2024-03(適格機関投資家専用)における換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.5%をかけた額。なお、投資者が実質的に負担する信託財産留保額は、前記「投資者が直接的に負担する費用」に記載の信託財産留保額となります。			

⚠ 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、主に国内外の転換社債を投資対象としますので、株価変動や金利変動等による組入転換社債の価格の下落、組入転換社債の発行体の倒産や財務状況の悪化等の影響により、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、「CB(転換社債)投資リスク」「為替変動リスク」「カントリーリスク」「流動性リスク」などがあります。詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

■分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

■ご留意いただきたい事項

- 当プレスリリースは投資の判断を行って頂くものではございません。
- 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。