NISSAY ASSET MANAGEMENT

News Release

ニッセイアセットマネジメント株式会社

2018年7月18日

ニッセイ日本株AIセレクトファンド(年2回決算型)
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:西　啓介)は、追加型の株式投資信託「ニッセイ日本株AIセレクトファンド(年2回決算型)」の設定・運用開始を2018年8月3日に予定しています。

当ファンドは、国内の金融商品取引所に上場している株式を実質的な主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

商　品　名	：ニッセイ日本株AIセレクトファンド(年2回決算型)
商品分類	：追加型投信／国内／株式
購入の申込期間	：2018年8月3日(金)以降
設　定　日	：2018年8月3日(金)
取扱販売会社	：株式会社SBI証券、楽天証券株式会社

※取扱い開始日等の詳細は、販売会社へお問合せください。

当ファンドの特色

① 日本企業の株式に投資します。

② AI(人工知能)を活用したニッセイアセットマネジメント独自の計量モデルを用いて、株価上昇が期待される銘柄を選別します。

- AI(人工知能)とは、Artificial Intelligenceの略で、学習・推論・判断といった人間の知能のもつ機能を備えたコンピュータ・システムのことをさします。
- 当ファンドは運用においてAIを活用しますが、AIに関する製品・サービスを開発・提供する企業などに特化して投資するものではありませんので、ご留意ください。
- 当ファンドでは運用担当者の監督のもと、原則としてAIを活用した計量モデルに基づき組入銘柄および投資比率を決定します。
- 計量モデルの活用にあたっては、株式会社MILIZEや株式会社True Data等が提供するシステムサポートやデータ等を利用します。
- 計量モデルの改良は継続的に行います。

③ 年2回決算を行い、分配金をお支払いすることをめざします。

- 毎年1・7月の各31日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。
  - 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して決定します。ただし、委託会社の判断により、分配を行わないことがあります。

! 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。

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		購入申込受付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		換金申込受付日の基準価額とします。
換金代金		換金申込受付日から起算して、原則として５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。
信託期間		2023年7月31日まで (設定日：2018年8月3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		1・7月の各31日 (該当日が休業日の場合は翌営業日)
受託会社		三菱UFJ信託銀行株式会社
投資者が直接的に負担する費用		
購入時	購入時手数料 (1万口当り)	購入申込受付日の基準価額に**3.24%(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。 ●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	ありません。
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1.1124%(税抜1.03%)**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	ファンドの純資産総額に年率0.0108%(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。

※ 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、主に国内の株式を投資対象としますので、組入株式の価格の下落、組入株式の発行会社の倒産または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。

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、「株式投資リスク」「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。

＜その他の留意点＞

ファンドは、AI(人工知能)を活用したニッセイアセットマネジメント独自の計量モデルを用いて、株価上昇が期待される銘柄に投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。AIを活用した計量モデルにしたがう運用が、パッシブ運用やボトム・アップ手法等によるアクティブ運用などの他の運用手法に対して優位性を持つ保証はありません。

計量モデルの改良は継続的に行うため、これによりAIの活用方法は将来変更されることがあります。

当該計量モデルが予測する投資銘柄の動き等は、実際の動きと異なる場合があります。また、ある時点でモデルが有効であったとしても、市場環境の変化等により、その有効性が持続しない場合があります。これらの場合等には、ファンドの資産価値が減少する要因となることがあります。

■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。

設定・運用は

ニッセイアセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者　関東財務局長(金商)第369号

加入協会：一般社団法人投資信託協会／一般社団法人日本投資顧問業協会