



NISSAY  
ASSET MANAGEMENT

# News Release

ニッセイアセットマネジメント株式会社

2017年6月1日

## ニッセイ・コーポレート・ハイブリッド証券ファンド 2017-06（為替ヘッジあり） 愛称：二刀流3（為替ヘッジあり） 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：赤林 富二）は、追加型の株式投資信託「ニッセイ・コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2017-06（為替ヘッジあり）」の設定・運用開始を2017年6月30日に予定しています。

当ファンドは、海外の企業（金融機関を含む）が発行するハイブリッド証券を実質的な主要投資対象とし、安定した金利収入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・コーポレート・ハイブリッド証券ファンド  
2017-06（為替ヘッジあり）

商品分類：追加型投信／海外／その他資産（ハイブリッド証券）

当初申込期間：2017年6月1日（木）～2017年6月29日（木）

継続申込期間：2017年6月30日（金）～2017年8月31日（木）

設定日：2017年6月30日（金）

取扱販売会社：三木証券株式会社、株式会社北洋銀行

### 当ファンドの特色

- ① 海外の企業（金融機関を含む）が発行するハイブリッド証券を主要投資対象とします。
  - 信託期間内に償還（満期償還または繰上償還。以下同じ）が見込まれるハイブリッド証券を中心に投資し、原則として償還日まで保有します。
    - ・一般的にハイブリッド証券は、繰上償還条項が付与されていますが、繰上償還の実施は発行体の決定によるため、繰上償還日に償還されることを前提として取引されている証券は、予定日に償還されない場合、または繰上償還を行わないと予想される場合、価格が下落することがあります。
    - ・繰上償還が実施されないことが懸念される場合等には、ファンドは保有するハイブリッド証券等を償還前に売却することがあります。
  - 信託期間内に組入証券が償還した場合などには、信託期間内に償還が見込まれるハイブリッド証券のほか、普通社債や国債等に投資することがあります。

#### <ハイブリッド証券とは>

普通社債と普通株式の特徴を併せ持つ証券で、具体的には劣後債、優先証券等があります。

- 劣後債とは普通社債と比べて弁済順位\*が低い債券をいい、一般に普通社債と比べて利回りが高くなっています。
- 優先証券とは弁済順位が劣後債と比べて低く、普通株式より優先される証券です。一般に劣後債に比べ、値動きが大きく、利回りが高くなっています。

\*弁済順位とは、発行体が経営破綻等に陥った場合に、債権者等に対して残余財産を弁済する順位のことで、

○上記は各ハイブリッド証券の特性等の一部を述べているものであり、市場環境等によっては異なる場合があります。

- ② 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。
  - 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。
- ③ 当ファンドは信託期間が約4年6ヵ月の限定追加型\*投資信託です。
  - 当ファンドの信託期間は、2017年6月30日から2021年12月28日までです。
  - 当ファンドの購入の申込みは、2017年8月31日までの間に限定して受け付けます。
    - ※「限定追加型」とは、当初設定時から一定期間追加募集を行い、その期間経過後は追加募集をしないタイプの投資信託をいいます。
- ④ 毎年、1・7月の各15日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、分配金をお支払いすることをめざします。
  - ・初回決算日は、2018年1月15日とします。

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。	
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6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	2021年12月28日まで（設定日：2017年6月30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15日（該当日が休業日の場合は翌営業日） ・初回決算日は、2018年1月15日とします。	
収益分配	年2回の毎決算日に、収益分配方針に基づき収益分配を行います。	
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）	購入申込受付日の翌営業日の基準価額（当初申込期間：1口当り1円）に <b>1.08%（税抜1.0%）を上限</b> 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 <b>0.3%</b> 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 <b>年率0.9936%（税抜0.92%）</b> 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。 また、ファンドが「ニッセイ・コーポレート・ハイブリッド証券Ⅱマザーファンド」を換金する際に信託財産留保額※をファンドからご負担いただきます（投資者が直接的に負担する費用ではありません）。 ※ニッセイ・コーポレート・ハイブリッド証券Ⅱマザーファンドの基準価額に0.3%をかけた額。

※ 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、主に外国のハイブリッド証券を投資対象としますので、金利変動等による組入証券の価格の下落、組入証券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、「ハイブリッド証券・債券投資リスク」「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。

### <その他の留意点>

○ファンドは、組入れたハイブリッド証券等が信託期間内に償還（満期償還または繰上償還。以下同じ）した場合などには、流動性やファンドの残存信託期間、為替ヘッジコスト等を勘案し、信託期間内に償還が見込まれるハイブリッド証券のほか、普通社債や国債等に投資することがありますが、償還までの期間が短かつ利回りの低いものである可能性があり、その結果ファンドの償還日が近づくにつれ、ファンドの利回りが低下する場合があります。

## ■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。