

プレスリリース

日興アセットマネジメント株式会社

「高金利先進国債券ファンド2(早期償還条項付)／愛称:オリーブ2」を設定

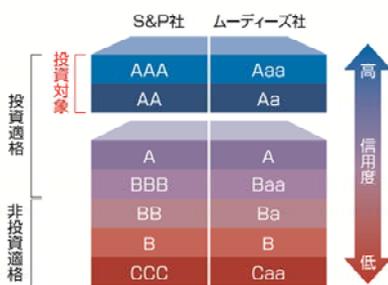
～ 群馬銀行が10月5日に募集開始 ～

日興アセットマネジメント株式会社(以下、「日興アセット」)は、単位型投信「高金利先進国債券ファンド2(早期償還条項付)／愛称:オリーブ2」を11月6日に設定、運用を開始する予定です。株式会社群馬銀行が10月5日に募集を開始します。

「高金利先進国債券ファンド2(早期償還条項付)／愛称:オリーブ2」は、主要先進国(OECD〔経済協力開発機構〕加盟国)の中から、信用力の高い先進国のソブリン債*1を中心に分散投資するファンドです。マザーファンドを通じて投資し、投資国については、適宜見直しを行いません。原則として、為替ヘッジは行いません。

*1 ソブリン債とは、各国政府や政府機関が発行する債券の総称です。主要先進国の国債や世界銀行、アジア開発銀行などの国際機関が発行する債券が含まれます。

債券の信用格付と当ファンドの投資対象



原則として、買付時においてスタンダード・アンド・プアーズ(S&P)社またはムーディーズ社からAA格またはAa格相当以上の長期債務格付が付与されている国のソブリン債に投資を行いません。

※格付は買付後に変更になる場合があります。

主要先進国(OECD*加盟国)の格付

| 国名 | S&P社 | ムーディーズ社 | 国名 | S&P社 | ムーディーズ社 |
|---------|------|---------|----------|------|---------|
| オーストラリア | AAA | Aaa | オーストリア | AA+ | Aaa |
| カナダ | AAA | Aaa | ニュージーランド | AA+ | Aaa |
| スイス | AAA | Aaa | アメリカ | AA+ | Aaa |
| スウェーデン | AAA | Aaa | チリ | AA+ | Aa3 |
| デンマーク | AAA | Aaa | フランス | AA | Aa1 |
| ドイツ | AAA | Aaa | ベルギー | AA | Aa3 |
| ノルウェー | AAA | Aaa | チェコ | AA | A1 |
| ルクセンブルグ | AAA | Aaa | 韓国 | AA- | Aa3 |
| イギリス | AAA | Aa1 | 日本 | AA- | A1 |
| フィンランド | AA+ | Aaa | エストニア | AA- | A1 |
| オランダ | AA+ | Aaa | | | |

(2015年7月末現在)

※OECD加盟国のうち、スタンダード・アンド・プアーズ(S&P)社またはムーディーズ社からAA格またはAa格相当以上の格付を付与された国の格付を記載しています。

※格付は自国通貨建て長期債務に対して付与されたものです。

* OECD(経済協力開発機構)とは

市場経済を原則とする先進国間の自由な意見交換・情報交換を通じて、1)経済成長、2)貿易自由化、3)途上国支援(以上「OECDの三大目的」)に貢献することを目的として、1961年に設立された機構です。

現加盟国は、オーストラリア、オーストリア、ベルギー、カナダ、チェコ、デンマーク、フィンランド、フランス、ドイツ、ギリシャ、ハンガリー、アイスランド、アイルランド、イタリア、日本、韓国、ルクセンブルグ、メキシコ、オランダ、ニュージーランド、ノルウェー、ポーランド、ポルトガル、スロバキア、スペイン、スウェーデン、スイス、トルコ、イギリス、アメリカ、チリ、スロベニア、イスラエル、エストニアの34カ国(2015年7月末現在)。

2015年7月末現在のマザーファンドの投資国



※投資国は、将来変更となる場合があります。

※上記の国々は投資国を表していますが、債券の発行体の属する国と発行通貨が異なる場合があるため、投資国と投資通貨が一致しない場合があります。

※上記は2015年7月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。

日興アセットマネジメント株式会社

〒107-6242 東京都港区赤坂 9-7-1 ミッドタウン・タワー

www.nikkoam.com

「オリーブ2」の主要投資対象である「高金利先進国債券マザーファンド」の運用は、「日興アセットマネジメント ヨーロッパ リミテッド」が行ないます。「日興アセットマネジメント ヨーロッパ リミテッド」は、日興アセットが 100%出資する海外持株会社の傘下にあるグローバル運用のイギリス拠点です。グローバル債券のほか、グローバル株式、マネー・マーケット、ストラクチャードプロダクトなどを中心に運用を行なっており、運用資産総額は約 2 兆 7,300 億円（助言を含む。2015 年 6 月末現在）に上ります。

◆早期償還条項と信託期間延長機能

「オリーブ2」の信託期間は約 4 年 1 ヶ月です。ただし、基準価額(分配金加算ベース)^{*2}が 2019 年 11 月 26 日以前の営業日に 11,500 円以上となった場合には、短期公社債などによる安定運用に移行後、繰上償還します。

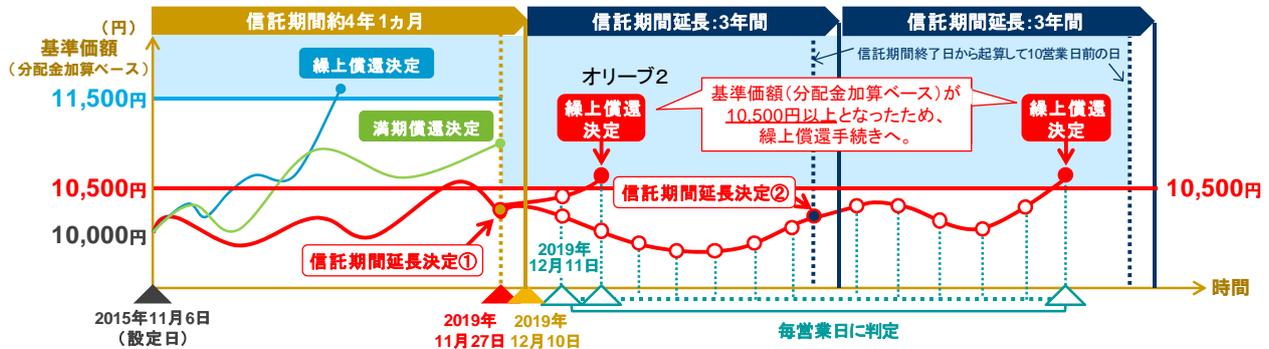
また、当ファンドには信託期間延長機能を設けています。2019 年 11 月 27 日(信託期間終了日から起算して 10 営業日前の日)の基準価額(分配金加算ベース)が 10,500 円未満の場合には、信託期間を 3 年^{*3}延長します。仮に信託期間を延長した場合、その後は、2019 年 12 月 11 日以降の毎営業日に判定を行ない、基準価額(分配金加算ベース)が 10,500 円以上となった場合には繰上償還します。信託期間延長後においても、信託期間終了日から起算して 10 営業日前の基準価額(分配金加算ベース)が 10,500 円未満の場合には、信託期間をさらに 3 年^{*3}延長します。こうした、信託期間終了時期にファンドの償還の延長を判定する機能により、元本割れの状態での償還の可能性を低減できると考えられます^{*4}。

マザーファンドの基準価額の推移



※上記は、当ファンドの主要投資対象である「高金利先進国債券マザーファンド」の運用実績であり、当ファンドの運用実績ではありません。
 ※当マザーファンドには信託報酬はかかりません。
 ※上記グラフ・データは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。運用開始後の状況については、ファンドの適時開示資料でご確認ください。

<信託期間延長と償還までのイメージ>



※ 基準価額(分配金加算ベース)の11,500円および10,500円は、あくまで繰上償還または満期償還の有無を判定するための水準であり、基準価額(分配金加算ベース)が11,500円または10,500円以上となることを示唆あるいは保証するものではありません。
 ※ 基準価額(分配金加算ベース)が2019年11月26日以前の営業日において11,500円または2019年12月11日以降の営業日において10,500円以上となった場合には、安定運用に移行します。安定運用への移行後も繰上償還するまでは、基準価額は市況動向などの影響を受けるため、基準価額(分配金加算ベース)や1万口当たり償還価額と設定来の1万口当たり収益分配金(税引前)累計額との合計額が11,500円または10,500円を下回る場合があります。

日興アセットは今後も、投資環境の変化を迅速に捉えた質の高い商品の開発と優れた運用パフォーマンスのご提供に努めてまいります。

以上

*2 基準価額(分配金加算ベース)は、1 万口当たり基準価額と設定来の 1 万口当たり収益分配金(税引前)累計額との合計額をさします。
 *3 3 年後の応当日が休業日の場合、翌営業日が信託期間終了日となります。
 *4 純資産総額が 10 億円を下回ることとなった場合などは、繰上償還することがあります。

■お申込メモ

| | |
|------------|--|
| 商品分類 | 単位型投信／海外／債券 |
| ご購入単位 | 購入単位につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。 |
| ご購入価額 | 1口当たり1円 |
| ご購入のお申込期間 | 2015年10月5日から2015年11月5日まで |
| 信託期間 | 2019年12月10日まで(2015年11月6日設定) 基準価額の水準によっては、信託期間が延長される場合があります。 |
| 決算日 | 毎年1月10日、7月10日(休業日の場合は翌営業日) |
| 収益分配 | 分配対象額は、元本超過額または経費控除後の配当等収益のいずれか多い額とします。 毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行いません。 ※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。 |
| ご換金価額 | 換金請求受付日の翌営業日の基準価額 |
| ご換金不可日 | 換金請求日が下記のいずれかに当たる場合は、換金請求の受付は行ないません。 詳しくは、販売会社にお問い合わせください。 ・英国証券取引所の休業日 ・ロンドンの銀行休業日 ・ニューヨーク証券取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行休業日 ・シドニー先物取引所の休業日 |
| ご換金代金のお支払い | 原則として、換金請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。 |
| 償還条項 | 2019年11月26日以前の営業日において、1万口当たり基準価額と設定来の1万口当たり収益分配金(税引前)累計額との合計額が11,500円以上となった場合には、安定運用に移行し、繰上償還します。 また、信託期間延長後は、2019年12月11日以降の営業日において、1万口当たり基準価額と設定来の1万口当たり収益分配金(税引前)累計額との合計額が10,500円以上となった場合には、安定運用に移行し、繰上償還します。 なお、純資産総額が10億円を下回ることとなった場合、繰上償還することがあります。 |
| 課税関係 | 原則として、分配金ならびに換金時および償還時の差益は課税の対象となります。 ※課税上は、株式投資信託として取り扱われます。 ※公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。 ※配当控除の適用はありません。 ※益金不算入制度は適用されません。 |

■委託会社、その他関係法人

- 委託会社： 日興アセットマネジメント株式会社
 投資顧問会社： 日興アセットマネジメント ヨーロッパ リミテッド
 受託会社： 野村信託銀行株式会社
 販売会社： 販売会社については下記にお問い合わせください。
 日興アセットマネジメント株式会社
 [ホームページ] <http://www.nikkoam.com/>
 [コールセンター] 0120-25-1404(午前9時～午後5時。土、日、祝・休日は除く。)

■手数料等の概要

お客さまには、以下の費用をご負担いただきます。

＜お申込時、ご換金時にご負担いただく費用＞

- 購入時手数料： 購入時手数料率は、2.16% (税抜 2%)を上限として販売会社が定める率が外枠でかかります。
 <<ご参考>>
 例えば、100万口ご購入いただく場合で、購入時手数料率が2.16%(税込)の場合は、次のように計算します。
 購入金額=1円×100万口=100万円、
 購入時手数料=購入金額(100万円)×2.16%(税込)=21,600円となり、
 購入金額に購入時手数料を加えた合計額102万1,600円をお支払いいただくこととなります。
- 換金手数料： ありません。
- 信託財産留保額： ありません。

＜信託財産で間接的にご負担いただく(ファンドから支払われる)費用＞

- 信託報酬： 純資産総額に対して年率 1.3392%(税抜 1.24%)を乗じて得た額
- その他費用： 目論見書などの作成・交付および計理等の業務にかかる費用(業務委託する場合の委託費用を含みます。)、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率 0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限とする額が信託財産から支払われます。
 組入有価証券の売買委託手数料、借入金の利息、立替金の利息および貸付有価証券関連報酬(有価証券の貸付を行なった場合は、信託財産の収益となる品貸料に0.54(税抜 0.5)を乗じて得た額)などについては、その都度、信託財産から支払われます。
 ※組入有価証券の売買委託手数料などは、運用状況などにより変動するものであり、事前に料率、上限額などを表示することはできません。

※当ファンドの手数料などの合計額については、投資者のみなさまがファンドを保有される期間などに
 応じて異なりますので、表示することはできません。

※詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

■リスク情報

投資者のみなさまの投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)のみなさまに帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

当ファンドは、主に債券を実質的な投資対象としますので、債券の価格の下落や、債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

主なリスクは以下の通りです。

【価格変動リスク】【流動性リスク】【信用リスク】【為替変動リスク】【有価証券の貸付などにおけるリスク】

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

■その他の留意事項

- 当資料は、投資者のみなさまに「高金利先進国債券ファンド2(早期償還条項付)／愛称:オリーブ2」へのご理解を高めさせていただくことを目的として、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。
- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- 当ファンドは、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により有価証券届出書を2015年9月18日に関東財務局長に提出しており、2015年10月4日よりその効力が発生します。なお、効力発生前に記載内容の訂正が行なわれる場合があります。
- 投資信託の運用による損益は、すべて受益者のみなさまに帰属します。当ファンドをお申込みの際には、投資信託説明書(交付目論見書)などを販売会社よりお渡します。内容を必ずご確認の上、お客様ご自身でご判断ください。

日興アセットマネジメントについて

日興アセットマネジメントは、日本そしてアジアを代表するグローバルな運用会社であり、世界の投資家の皆様へ一流の投資ソリューションを提供しています。世界30以上の国から集まる豊富な人材を世界11カ国に擁し、約200名*の運用プロフェッショナルが19兆円余り**の資産を運用しています。55年の実践を経た投資哲学をアジアから世界へ広げていきます。

(上記データはすべて2015年6月末現在)

* 日興アセットマネジメント株式会社および連結子会社の役員を含む。

** 日興アセットマネジメント株式会社および海外子会社の連結運用資産残高(投資助言を含む)の2015年6月末現在のデータ

日興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368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、日本証券業協会

日興アセットマネジメント株式会社

〒107-6242 東京都港区赤坂 9-7-1 ミッドタウン・タワー

www.nikkoam.com