

損保ジャパン日本興亜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351号
 加入協会：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
 【本件に関するお問い合わせ】 営業部 03-5290-3519

「グローバル好利回りCBファンド2012-09（円ヘッジ）（限定追加型）」の設定

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社は、「グローバル好利回りCBファンド2012-09（円ヘッジ）（限定追加型）」を2012年9月26日に設定しますので、お知らせいたします。

商品分類及び属性区分

商品分類		属性区分					
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
追加型	内外	債券	その他資産 (投資信託証券(債券 社債))	年1回	グローバル (日本を含む)	ファンド オブ・ファンズ	為替ヘッジあり (フルヘッジ)

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

商品分類及び属性区分の定義につきましては、社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて信託財産の成長を図ることを目的とします。

ファンドの特色

1 主として日本を含む世界各国の相対的に好利回りの転換社債(CB)等※を 実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を目指します。

※CBは「Convertible Bond」の略称で、転換社債(転換社債型新株予約権付社債)を指します。

■当ファンドは、UBPインベストメンツが運用する外国投資法人「Triangle II Fund - Global CB Fund*」、および損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントが運用する投資信託証券「マネーボールマザーファンド」を主要投資対象とするファンド・オブ・ファンズ方式で運用します。

■原則として、「Triangle II Fund - Global CB Fund」への投資比率を高位に保ちます。

■「Triangle II Fund - Global CB Fund」の運用は、UBPインベストメンツ(投資顧問会社)の委託を受けたユニオン・バンケール・プリヴェ・ユービーピー・エスエー(副投資顧問会社)が、ユニオン・バンケール・ジェスティヨン・アンスティテュシオネル(フランス)エスエーの助言を受けて行います。

*「Triangle II Fund - Global CB Fund」の運用について

I. 原則として、信託期間(約3年)内に満期もしくは償還請求期限*1を迎える世界各国の相対的に好利回りの転換社債(CB)等に投資を行います。*2

II. ポートフォリオ構築後は、原則として「バイ&ホールド戦略*3」を行い、利金収入と償還差益等*4の獲得を目指します。

III. 組入外貨建資産に対し、原則として対円での為替ヘッジ取引を行い、為替変動リスクを低減する運用を行います。

*1 「償還請求期限」とは、転換社債の投資家が発行体に、償還期限より前の所定の日に、所定の価格で償還を行うよう求める選択権(オプション)の行使期限のことです。

*2 信託期間内に満期及び償還を迎える転換社債(CB)の償還金については、原則として、上記Iの条件を満たす転換社債(CB)へ再投資を行います。信託期間終了までの残存期間やキャッシュマネジメント等によっては、再投資を行わず短期有価証券や短期金融商品による運用を行う場合があります。

*3 「バイ&ホールド戦略」とは、銘柄買付後、満期及び償還まで保有する投資戦略です。ただし、当ファンドにおいては、発行体の信用状況の悪化やキャッシュマネジメント等によっては、途中売却を行う場合があります。その場合、償還まで保有した場合の利益を大きく下回る場合があります。

*4 発行体が倒産等した場合は、償還されないことがあります。その場合、基準価額が大きく下落する可能性があります。

UBPインベストメンツ株式会社について

- ユニオン・バンケール・プリヴェ・ユービーピー・エスエー(以下、UBPといいます)の日本拠点
- UBPIはスイスを代表する資産運用会社の一つ
- UBPIは1969年スイスで設立。グローバルに24拠点を展開
- UBPIの運用資産額:約801億米ドル(約6兆3,527億円)
- UBPIは世界の個人投資家・機関投資家に様々な運用戦略を提供 (2012年6月末現在)

ユニオン・バンケール・ジェスティヨン・アンスティテュシオネル(フランス)エスエーについて

- UBPIのフランス拠点
- 転換社債の運用に特化(1999年6月より約13年間の運用実績)
- 運用資産額は約11億ユーロ(約1,086億円:2012年6月末現在)

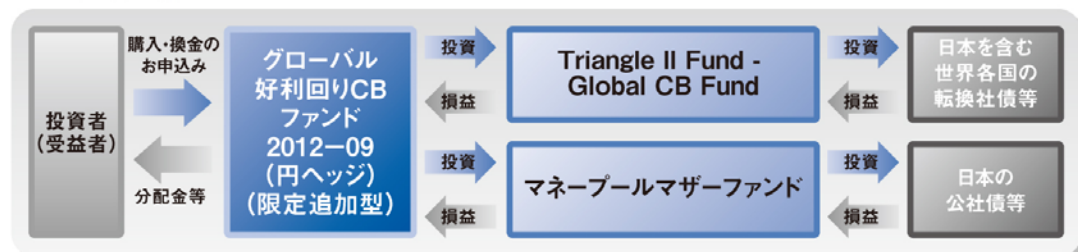
※当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の名称及びその運用会社の名称等は今後変更となる場合があります。

2 当ファンドの信託期間※は約3年間です。

※当ファンドの信託期間は、2012年9月26日(水)から2015年9月25日(金)までです。

ファンドの仕組み

当ファンドは「ファンド・オブ・ファンズ」です。「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、主として複数の他の投資信託(ファンド)を組入れることにより運用を行います。



主な投資制限

- ◆ 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ◆ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ◆ デリバティブの直接利用は行いません。
- ◆ 株式への直接投資は行いません。
- ◆ 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

分配方針

毎決算時(原則として9月25日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ① 分配対象額の範囲
経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。
- ② 分配対象収益についての分配方針
収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。
- ③ 留保益の運用方針
留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

※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。

投資リスク

《基準価額の変動要因》

当ファンドの基準価額は、組入れられる有価証券等の値動き等による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属いたします。したがって、投資者の皆様は投資元本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、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金とは異なります。

当ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

※基準価額の変動要因は、以下に限定されるものではありません。

◆価格変動リスク

転換社債等の価格は、国内外の政治・経済情勢、市況等の影響を受けて変動します。また、発行体の株式の価格が転換価格に近いときまたは上回っているときに、当該株式の価格変動に敏感に反応することが多いといえます。組入れている転換社債等価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

◆信用リスク

転換社債等の価格は、発行体の財務状態、経営、業績等の悪化及びそれらに関する外部評価の悪化等により下落することがあります。組入れている転換社債等の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また発行体の倒産や債務不履行等の場合は、転換社債等の価値がなくなることもあり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。なお、当ファンドは無格付または低格付の転換社債等を組入れる場合があります、投資適格の転換社債を組入れる場合に比べ信用リスクが高いといえます。

◆流動性リスク

国内外の政治・経済情勢の急変、天災地変、発行体の財務状態の悪化等により、有価証券等の取引量が減少することがあります。この場合、ファンドにとって最適な時期や価格で、有価証券等を売買できないことがあり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

また、取引量の著しい減少や取引停止の場合には、有価証券等の売買ができなかったり、想定外に不利な価格での売買となり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

※当ファンドは実質的に株式への投資を行うことがあります（転換社債等の転換により、株式を保有する場合を含みます）。株式への投資には、価格変動リスク、信用リスク、流動性リスクがあります。

◆カントリーリスク

一般的に、主要先進国以外の国では、主要先進国に比べて、経済が脆弱である可能性があり、国内外の政治・経済情勢、取引制度、税制の変化等の影響を受けやすく、また市場規模や取引量が小さいこと等から有価証券等の価格がより大きく変動することがあり、ファンドの基準価額が大きく下落することがあります。

◆為替変動リスク

当ファンドは原則として、外貨建資産に対して、為替ヘッジを行います。が、全ての為替変動リスクを排除できるものではありません。また円金利よりも金利水準の高い通貨の為替ヘッジを行った場合、金利差に相当するヘッジコストが発生し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

《その他の留意点》

◆クーリングオフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用はありません。

◆収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、収益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。収益分配金は、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、収益分配金の水準は、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。投資者のファンドの購入価額によっては、収益分配金の一部又は全部が、実質的には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、収益分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

◆ファンドが投資対象とする外国投資信託に対し他のファンドによる追加設定または一部解約等があり、当該外国投資信託において有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を受ける可能性があります。

《リスクの管理体制》

委託会社では、取締役会が決定した運用リスク管理に対する取組方針に基づき、運用担当部から独立した部署及び社内委員会において運用に関する各種リスク管理を行います。

手続・手数料等

お申込みメモ

購入の申込期間	当初申込期間 平成24年9月6日から平成24年9月25日まで 継続申込期間 平成24年9月26日から平成24年9月27日まで ・平成24年9月28日以降のお申込みは受け付けません。
購入単位	販売会社が定める単位 ※詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
購入価額	当初申込期間 1口当たり1円 継続申込期間 購入申込受付日の翌営業日の基準価額
購入代金	販売会社が定める日までにお支払いください。
換金単位	販売会社が定める単位 ※詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
換金価額	換金請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した額
換金代金	換金請求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。 換金の申込金額が多額であると判断した場合、主要投資対象とする投資信託証券の解約および換金の停止ならびに基準価額算出の中止、取引所における取引の停止等*その他やむを得ない事情により、有価証券の売却(主要投資対象とする投資信託証券の解約または換金を含みます。)や売却代金の入金が遅延したとき等は、換金代金の支払いを延期する場合があります。 ※外国為替取引の停止、決済機能の停止、取引市場における流動性が極端に低下した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の算出が困難となった場合、投資対象国等における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、税制の変更、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等)による市場の閉鎖または流動性の極端な低下もしくは資金決済に関する障害等をいいます。以下同じ。
申込不可日	・ ロンドンの銀行の休業日 ・ ニューヨークの銀行の休業日 ・ ロンドンの証券取引所の休業日 ・ ニューヨークの証券取引所の休業日 ・ 上記各休業日(土曜日、日曜日を除く)の4営業日前までの期間
申込締切時間	原則として午後3時まで(販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては販売会社までお問い合わせください。)
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求を制限する場合があります。
購入・換金 申込受付の中止 及び取消し	委託会社は、購入・換金の申込金額が多額であると判断した場合、主要投資対象とする投資信託証券の申込み・解約及び換金の停止ならびに基準価額算出の中止、取引所における取引の停止等その他やむを得ない事情があると判断したときは、購入・換金の受付を中止すること、及び既に受付けた当該申込みの受付を取り消すことができるものとします。
信託期間	平成27年9月25日まで(設定日 平成24年9月26日) ※委託会社は、信託約款の規定に基づき、信託期間を延長することができます。
繰上償還	主要投資対象とする投資信託証券のいずれかが存続しないこととなった場合、受益権の残存口数が10億口を下回ることとなった場合、繰上償還することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、繰上償還させることがあります。
決算日	原則、9月25日。(休業日の場合は翌営業日) ※初回決算日は平成25年9月25日。
収益分配	毎決算時(年1回)、収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。 ※当ファンドは、分配金を受取る一般コースのみとなります。
信託金の限度額	300億円
公告	日本経済新聞に掲載します。
運用報告書	原則、毎決算時及び償還時に、運用報告書を作成し、あらかじめお申し出いただいたご住所に販売会社を通じて交付します。
課税関係	課税上は株式投資信託として取扱われます。配当控除、益金不算入制度の適用はありません。

ファンドの費用・税金

ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用		
購入時手数料	購入価額に、 <u>2.625%(税抜2.5%)</u> を上限として販売会社が定めた手数料率を乗じた額です。 ※詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。	
信託財産留保額	換金請求受付日の翌営業日の基準価額に <u>0.5%</u> を乗じた額です。	
投資者が信託財産で間接的に負担する費用		
運用管理費用 (信託報酬)	ファンドの日々の純資産総額に対して <u>年率0.7035%(税抜0.67%)</u> を乗じた額とし、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日及び毎計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。 運用管理費用(信託報酬)の配分は以下の通りです。	
	委託会社	年率0.2625%(税抜0.25%)
	販売会社	年率0.4095%(税抜0.39%)
	受託会社	年率0.0315%(税抜0.03%)
投資対象とする 投資信託証券の 信託報酬等	<u>年率0.45%</u> ※上記のほか、ファンドの開示に関する費用(監査報酬、弁護士報酬)等がかかります。	
実質的な運用管理費用 (信託報酬)	ファンドの純資産総額に対して <u>概ね1.1535%(税込・年率)程度</u> となります。 ※当ファンドの運用管理費用(信託報酬)年率0.7035%(税抜0.67%)に投資対象とする投資信託証券の信託報酬等(年率0.45%)を加算しております。投資信託証券の組入状況等によって、当ファンドにおける、実質的に負担する運用管理費用(信託報酬)は変動します。	
その他の費用・ 手数料	◆監査報酬 ファンドの日々の純資産総額に定率(年0.0021%(税抜0.0020%))を乗じた額とします。但し、実際の費用額(年間26.25万円(税抜25万円))を上限とします。 なお、上限額は変動する可能性があります。 ◆その他の費用(*) ・組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料 ・売買委託手数料に対する消費税等相当額 ・コール取引等に要する費用 ・外国における資産の保管等に要する費用 ・信託財産に関する租税 ・受託会社の立替えた立替金の利息 等 (*)「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。	

※当該手数料等の合計額については、投資者の皆様がファンドを保有される期間、売買金額等に応じて異なりますので、表示することができません。

税金

・税金は表に記載の時期に適用されます。

・以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分配時	所得税及び地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して10%
換金(解約)時 及び償還時	所得税及び地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時及び償還時の差益(譲渡益)に対して10%

※上記は平成24年7月末現在のものです。平成25年1月1日以降は10.147%となる予定です。

なお、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

※法人の場合は上記とは異なります。

※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■委託会社（信託財産の運用指図等を行います。）

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

■受託会社（信託財産の保管・管理等を行います。）

株式会社りそな銀行（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

■販売会社（受益権の募集の取扱、販売、一部解約の実行の請求の受付、ならびに収益分配金、償還金および一部解約金の支払等を行います。）

いちよし証券株式会社

ご注意事項

- ・当資料は、ニュースリリースとして損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社が作成した資料です。したがって、勧誘を目的としたものではありません。また、法令に基づく開示書類ではありません。
- ・当資料に記載されている各事項は、作成時点のものであり、予告なしに変更する場合があります。
- ・投資信託は、主として値動きのある証券等に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。したがって、元金が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が生じ、投資元金を割り込むことがあります。また、運用による損益はすべて投資者の皆様へ帰属いたします。
- ・投資信託の取得のお申込みにあたっては、販売会社から投資信託説明書（交付目論見書）を予め、または同時にお渡しいたしますので、必ずお受け取りいただき、投資信託説明書（交付目論見書）の内容を十分にお読みいただいた上、ご自身でご判断ください。なお、投資信託説明書（交付目論見書）の提供は、販売会社において行います。