

【表紙】

【提出書類】 臨時報告書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 2019年10月18日提出

【ファンド名】 ニッセイ米ドル建て短期ハイ・イールド債券ファンド
通貨プレミアムコース
ニッセイ米ドル建て短期ハイ・イールド債券ファンド
為替ヘッジありコース
ニッセイ米ドル建て短期ハイ・イールド債券ファンド
為替ヘッジなしコース

【発行者名】 ニッセイアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 西 啓介

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号

【事務連絡者氏名】 投資信託企画部 茶木 健

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号

【電話番号】 03 - 5533 - 4608

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【提出理由】

契約型追加型証券投資信託「ニッセイ米ドル建て短期ハイ・イールド債券ファンド 通貨プレミアムコース」、「ニッセイ米ドル建て短期ハイ・イールド債券ファンド 為替ヘッジありコース」、「ニッセイ米ドル建て短期ハイ・イールド債券ファンド 為替ヘッジなしコース」(以下、各コースのそれぞれを「ファンド」といいます)について、信託終了(繰上償還)にかかる手続きを開始することを決定しましたので、金融商品取引法第24条の5第4項に基づく特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令第29条第2項第14号の規定にしたがい本臨時報告書を提出するものです。

2【報告内容】

イ．信託終了(繰上償還)の年月日

2020年2月20日(予定)

各ファンドにおける書面決議が可決された場合、信託を終了(繰上償還)します。

ロ．信託終了(繰上償還)にかかる決定に至った理由

各ファンドは、2013年の設定以来、主要投資対象である「A Bケイマン・マスター・トラスト・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ファンド カレンシー・プレミアム・クラス/円ヘッジクラス/円クラス」(以下「外国投資信託」といいます)を通じて、主に米ドル建ての短期ハイ・イールド債券に実質的な投資を行ってまいりましたが、外国投資信託の運用会社であるアライアンス・バーンスタイン・エル・ピーから、「運用資産の減少傾向が継続しているため、運用の基本方針に沿った運用や十分な分散投資が困難な状況にある」との申し出がありました。

2019年9月17日時点における外国投資信託の運用資産の円換算額は約8.3億円となっており、今後とも減少が続いた場合、十分な銘柄数の組入れによる分散投資が一層困難となり、基準価額の下落リスクが高まることも予想されることから、各ファンドを繰上償還し、受益者の皆様よりお預かりいたしました運用資産をお返しすることが、受益者の皆様にとって最善であると判断し、各ファンドの信託終了(繰上償還)を行うことにつきご提案させていただくものいたしました。

ハ．信託終了(繰上償還)に関する情報の受益者への提供または公衆縦覧

2019年10月23日現在の各ファンドの知れている受益者を対象とし、書面による決議を行うため、書面決議の日および投資信託契約の解約の理由等の事項を記載した書面決議の通知を発送します。