

## 【表紙】

【提出書類】	臨時報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年1月24日提出
【ファンド名】	ニッセイ・コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015 - 12（為替ヘッジあり）
【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・コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-12（為替ヘッジあり）」（以下「当ファンド」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3月13日（予定）

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

当ファンドは、「ニッセイ・コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます）を通じて、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等を主要投資対象として運用を行ってまいりましたが、マザーファンドにおいて一銘柄あたりの投資割合が信託約款に定められた投資制限の上限に近づいてきています。

今後、マザーファンドで保有する組入証券が償還を迎えた際に、金利低下が続く環境下では、既に保有している銘柄以外の適切な代替銘柄が見つからず、短期資金として保有せざるを得ない状況が続き、その結果、短期資金等の保有比率も今後上昇していく懸念が高まってきています。

マザーファンドの有価証券の組入比率を高位に維持しつつ、信託約款に定められた運用方針に則った運用を継続することが困難となってきたことから、マザーファンドを主要投資対象としている当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、当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

2020年1月29日現在の当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。