

ニュースリリース

2008年12月1日

'08年12月1日より野村證券で募集開始

日経平均参照型投信 0812 を募集・設定

T&D保険グループのT&Dアセットマネジメント株式会社(東京都港区、代表取締役社長:荒尾 耿介)は、「日経平均参照型投信 0812」を本年12月11日に設定します。

当ファンドの特徴

- 当ファンドは、日経平均株価の変動に基づき、償還価格、償還時期が決定されるユーロ円建債券への投資により、所定の期間における日経平均株価の変動による収益の確保と損失の軽減を目標に運用を行います。
- 原則として、Nomura Europe Finance N.V.が発行するユーロ円建債券をできるだけ高位に組み入れます。

当ファンドの基準価額は日経平均株価と完全に連動するものではありません。そのため、当ファンドの値動きと日経平均株価の値動きは、必ずしも一致するものではありません。



当初募集期間: 2008年12月1日(月)から12月10日(水)まで
設 定 日: 2008年12月11日(木)
取扱販売会社: 野村證券株式会社

T&Dアセットマネジメントは、今後も投資家の皆さまに信頼される商品の提供と運用に努めてまいります。

* 本件に関するお問い合わせ *

T&Dアセットマネジメント株式会社 投信マーケティング部 正木・中井
電話 03-3434-5544 <http://www.tdasset.co.jp/>

当ファンドの特徴

1 当ファンドは、下記の条件を満たした場合、**償還時の元本を確保することを目指します。**

当ファンドは、株価参照期間^{#1}(平成20年12月18日~平成25年12月10日)中に、日経平均株価(終値を含む全ての値)が一度も下記のノックイン株価^{#2}以下にならなかった場合、償還時の元本を確保することを目指します。

$$\text{ノックイン株価} = \text{スタート株価}^{\#3} \times 63\%$$

2 当ファンドは、下記の条件を満たした場合、**早期償還を行い、償還価額は12,000円程度の確保を目指します。**

平成21年3月10日以降、毎月の早期償還判定日^{#4}において、日経平均株価(終値)がスタート株価の120%の水準以上になった場合、同月の早期償還実行日^{#5}に早期償還を行い、償還価額は12,000円程度の確保を目指します。

早期償還判定日(毎月10日)の日経平均株価(終値)が、

スタート株価の120%の水準以上の場合

➔

12,000円程度の基準価額により早期償還

スタート株価の120%の水準未満の場合

➔

早期償還は行いません(運用継続)

3 上記の条件で早期償還が行われなかった場合、当ファンドは平成25年12月25日に満期償還となります。

平成21年3月10日以降、毎月の早期償還判定日において、日経平均株価(終値)が一度もスタート株価の120%の水準以上にならなかった場合、ファンドは平成25年12月25日に満期償還となります。満期償還価額は、株価参照期間中の日経平均株価(終値を含む全ての値)の推移やゴール株価^{#6}の水準によって決まるため、**元本割れとなる場合があります。**

株価参照期間中において日々の日経平均株価(終値を含む全ての値)が、

(ケース1)
一度もノックイン株価以下にならなかった場合

➔

ゴール株価を反映した基準価額(10,000円程度を下限、12,000円程度を上限とします。)で満期償還となります。

(ケース2)
一度もノックイン株価以下になった場合

➔

ゴール株価を反映した基準価額(12,000円程度を上限とします。)で満期償還となります。当該株価がスタート株価を下回っていた場合には、元本割れとなる場合があります。

- 1 株価参照期間：投資対象となるユーロ円建債券発行日(平成20年12月18日)から平成25年12月10日まで。
- 2 ノックイン株価：スタート株価(3) × 63%の株価水準です。
- 3 スタート株価：平成20年12月11日から平成20年12月15日の3営業日における日経平均株価終値の平均値(小数第3位四捨五入)です。
- 4 早期償還判定日：平成21年3月10日から平成25年11月10日までの毎月10日(休業日の場合は翌営業日)とします。
- 5 早期償還実行日：早期償還判定日において日経平均株価(終値)がスタート株価の120%の水準以上になった場合、自動的に早期償還が行われる日。(平成21年3月18日以降の毎月18日(東京またはロンドンの銀行が休業日の場合は、東京及びロンドンの銀行が共に営業する翌営業日)から起算して5営業日目以降)
- 6 ゴール株価：平成25年12月6日から平成25年12月10日の3営業日における日経平均株価終値の平均値(小数第3位四捨五入)です。

<日経平均株価について>

「日経平均株価」とは、(株)日本経済新聞社および(株)日本経済新聞デジタルメディアが東証一部上場銘柄のうち、代表的な225銘柄を対象に算出・公表している株価指数です。「日経平均株価」に関する著作権ならびに「日経平均株価」の表示に対する知的財産権その他一切の権利は全て(株)日本経済新聞社に帰属します。(株)日本経済新聞社は、「日経平均株価」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有します。当ファンドが主要投資対象とするユーロ円建債券について、(株)日本経済新聞社および(株)日本経済新聞デジタルメディアは一切の義務ないし責任を負いません。

日経平均参照型投信 0812

お申込メモ

商品分類	単位型株式投資信託 / バランス型
主な投資対象	内外の公社債、特に日経平均株価の変動に基づき、償還価格、償還時期が決定されるユーロ円建債券を主要投資対象とします。
信託設定日	平成20年12月11日
信託期間	約5年(償還日:平成25年12月25日)
申込期間	平成20年12月1日～平成20年12月10日
決算日	毎年12月25日に決算を行います。(ただし、該当日が休業日の場合は翌営業日)
収益分配	毎決算時に、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配を行います。ただし、必ず分配を行うものではありません。
申込単位	1口以上1口単位
申込価額	1口あたり10,000円 平成20年12月10日までに、申込代金(申込金額に申込手数料(税込)を加算した金額をいいます。)を販売会社にお支払いいただきます。
クローズド期間	平成21年3月10日まで(3ヵ月)は、途中換金の受付は行いません。
換金の申込受付日	平成21年3月11日以降、原則として毎営業日(ただし、ロンドンの銀行の休業日の場合を除きます。)にお申込できます。お申込の受付時間は午後1時30分(国内の金融商品取引所の半日立会日は午前9時30分)までとなります。
換金単位	1口以上1口単位
換金価額	換金価額は、換金申込日の基準価額から信託財産留保額(当該基準価額の0.3%)を差し引いた額となります。 換金代金のお支払いは、原則としてお申込日から起算して7営業日目以降となります。

当ファンドに係る手数料等について *お客さまには以下の費用をご負担いただきます。

ご購入時に直接ご負担いただく費用

申込手数料 申込価額に対して3.15%(税抜3.0%)

投資信託の保有期間中に間接的にご負担いただく費用

信託報酬 投資信託財産の元本総額に対して年0.987%(税抜0.94%)の率を乗じて得た額

監査報酬 投資信託財産の純資産総額に対して年0.0084%(税抜0.008%)の率を乗じて得た額

その他 有価証券の保管費用、売買時の売買委託手数料等がかかります。その他費用については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

ご換金時に直接ご負担いただく費用

信託財産留保額 換金申込日の基準価額に対して0.3%の率を乗じて得た額

換金手数料 ありません。

当該手数料等の合計額については、ご投資家の皆さまがファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

詳細につきましては必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をお読みください。

当ファンドの投資リスクについて

当ファンドに生じた利益および損失は、全て投資家に帰属し、投資元本が保証されているものではありません。また、収益や投資利回り等も未確定の商品です。

当ファンドの基準価額の変動要因となる主なリスクは次の通りです。

価格変動リスク 信用リスク 流動性リスク 銘柄集中投資リスク 金利変動リスク

当ファンドのリスクは上記に限定されるものではありません。

詳細につきましては必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をお読みください。

主要投資対象のユーロ円建債券について

- Nomura Europe Finance N.V.が発行するユーロ円建債券(以下、当該債券といたします。)を主要投資対象とし、できるだけ高位に組み入れます。
- 当該債券は発行者の無担保優先一般債務で、支払いは野村ホールディングス(株)により保証されております。
- 野村ホールディングス(株)の格付けは、A-(スタンダード&プアーズ)、A3(ムーディーズ)です。
本格付けは2008年10月31日現在のものであり、将来変更となる可能性があります。

<投資先のユーロ円建債券についてのご留意事項>

法令等の規制または市場環境の変化等により流動性(換金性)が低くなり、当該債券を売却することができない可能性があり、解約請求の受付を繰り延べる場合があります。 当該債券の発行者は、日本または発行者の所在地等の税制の変更により、当該債券を公正な市場価格から必要諸経費を差し引いた金額で早期償還することがあります。 当該債券の早期償還の決定に重大な影響を及ぼすと当該債券の計算代理人(以下、代理人といたします。)が判断した場合(市場混乱事由)、当該早期償還判定日は市場混乱事由のない翌取引所営業日以降に延期されます。その際、日経平均株価の終値として当該債券の早期償還の決定に用いる価格は、代理人が市場環境を考慮した上で決定します。 当該債券におけるスタート株価若しくはゴール株価の参照日(以下、平均価格参照日といたします。)において市場混乱事由が発生した場合、当該平均価格参照日は、他の平均価格参照日と重複せず、かつ市場混乱事由のない翌取引所営業日以降に延期されます。その際、日経平均株価の終値としてスタート株価若しくはゴール株価の決定に用いる価格は、代理人が市場環境を考慮した上で決定します。 日経平均株価の計算方法に重大な変更があった場合、公表がなされなかった場合、又は中止された場合で、代理人が認めた場合、代理人が当該指数の値を決定することがあります。またこれらの事態が発生した場合は、当該債券の発行者は当該債券を公正な市場価格から必要諸経費を差し引いた金額で早期償還することがあります。

ご留意いただきたい事項

当資料は、ニュースリリースとしてT&Dアセットマネジメントが作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。また、勧誘を目的に使用することはできません。

当資料は、信頼できると判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。

当資料の内容は作成時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。

投資信託は、リスクを含む商品であり、株式および公社債等値動きのある有価証券(外国証券には為替のリスクもあります。)に投資しますので、運用実績は市場環境等により変動します。したがって、元本が保証されているものではありません。これら運用による損益はすべて投資家の皆さまに帰属します。

投資信託は、預貯金や保険契約と異なり、預金保険・貯金保険・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関でご購入いただいた場合、投資者保護基金の対象とはなりません。

取得のお申込にあたっては、投資信託説明書(交付目論見書)をお渡ししますので必ず内容をご確認のうえ、ご自身でご判断いただきますようお願いいたします。投資信託説明書(交付目論見書)は各販売会社にてご入手いただけます。

以上