

2019年10月23日

受益者の皆様へ

ニッセイアセットマネジメント株式会社

「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」  
信託終了（繰上償還）（予定）に関する決議のお知らせ

拝啓 時下ますますご清祥のこととお慶び申し上げます。

また平素は格別のご高配を賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、「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」および「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、それぞれを「各ファンド」といいます。）は、2013年の設定以来、主要投資対象である「AB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。

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）を行うことにつき提案させていただくこととなりました。

信託終了（繰上償還）につきましては、「投資信託及び投資法人に関する法律」および信託約款の規定にしたがい、書面による決議をもって実施する予定です。

つきましては、お手数ですが本書面および「書面決議参考書類」をお読みいただき、信託終了（繰上償還）に関する決議の賛否および必要事項を、同封の「議決権行使書面」にご記入のうえ、弊社までご送付いただきますようお願い申し上げます。

なお、書面による決議は各ファンドごとに行われるため、決議の結果によっては、いずれかのファンドのみが繰上償還となり、他のファンドは繰上償還とならない場合があります。

受益者の皆様におかれましては、何卒ご理解賜りますよう、宜しくお願い申し上げます。

敬具

## 記

### 1. 書面による決議の手続きおよび日程

① 受益者様の確定	2019年10月23日
② 「議決権行使書面」受付期限	2019年11月21日の弊社到着分まで
③ 書面による決議の日 (信託終了(繰上償還)の可否決定日)	2019年11月25日
④ 信託終了(繰上償還)日(予定)	2020年2月20日

- ① 書面による決議は、2019年10月23日時点で、各ファンドを保有されている受益者の皆様を対象としております。(10月23日時点での受益権口数が議決権の数となります。)
- ② 対象となる受益者の皆様は、上記の受付期限までに、ニッセイアセットマネジメント株式会社に対し、本書面に同封してお届けしております「議決権行使書面」をもって、本決議における議決権を行使ください。
- ③ 本決議は、各ファンドごとに、議決権を行使できる受益者の議決権の3分の2以上の賛成をもって可決されます。前述に満たず否決された場合は、本手続きによる信託終了(繰上償還)を行いません。行わない場合は、信託終了(繰上償還)を行わない旨を、書面による決議の日以降速やかに受益者の皆様にお知らせいたします。
- 信託終了(繰上償還)に関する決議の結果は、可決または否決いずれの場合でも、上記書面による決議の日の翌日までに、弊社ホームページ(<https://www.nam.co.jp/>)にて掲載いたします。
- ④ 信託終了(繰上償還)となる場合、2020年2月20日が信託終了(繰上償還)日となります。
- なお、各ファンドのご購入のお申込期間は、2020年2月17日までとなります。

### 2. 書面による決議の方法

同封の「議決権行使書面」に、各ファンドの信託終了(繰上償還)について賛成または反対される旨等をご記入のうえ以下の宛先にご送付ください(同封の返信用封筒をご利用ください)。

2019年11月21日弊社到着分までを有効とさせていただきます。

なお、本決議におきまして議決権を行使されない場合(「議決権行使書面」をご返送いただかない場合)は、信託終了(繰上償還)に賛成するものとさせていただきます。

宛先 〒100-8219 東京都千代田区丸の内1丁目6番6号 日本生命丸の内ビル  
ニッセイアセットマネジメント株式会社 投資信託企画部 償還担当  
(同封の返信用封筒は料金受取人専用のため、別の郵便番号となっています。)

ご注意いただきたい事項

- 本手続きにあたり、お客様に関する情報を販売会社および委託会社（弊社）が共有することがあります。なお、本手続きにともない取得した個人情報を書面による決議に関する事務を処理するためだけに利用し、それ以外の目的には使用いたしません。
- 同一受益者の方が重複して議決権を行使された場合で、議決権行使の内容が異なる場合は、全ての議決権に関して無効とさせていただきますのでご了承くださいませようお願い申し上げます。
- 賛否の表示のない議決権行使書面は、賛成の表示があるものとしてお取扱いいたします。
- 議決権行使書面に不備または不明な点がある場合、確認のご連絡を差し上げることがありますので、ご了承ください。

### 3. 反対された受益者の受益権買取請求の不適用について

各ファンドは、受益者が換金請求された際に、委託会社が信託契約の一部を解約することにより、公正な価格をもって支払いに応じることができます。そのため、信託終了（繰上償還）についての書面による決議において反対された受益者からの受益権買取請求は適用されないこととしております。

（2014年12月1日の法令等改正施行にともない、不適用とする信託約款変更を行っております。）

「議決権行使書面」受付期限まで、また期限終了後においても、信託終了（繰上償還）への賛否にかかわらず、販売会社においては通常通りご換金のお申込みを受付けいたします。

以上

<本書面に関するお問合せは>

ニッセイアセットマネジメント株式会社 コールセンター

電話番号 0120-762-506（午前9時～午後5時 土、日、祝祭日は除きます）

## 書面決議参考書類

### 1. 投資信託契約の解約の理由および相当性に関する事項

「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」および「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、それぞれを「各ファンド」といいます。）の主要投資対象である「AB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。）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。

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、各ファンドの投資信託契約の解約（繰上償還）を提案いたします。

### 2. 投資信託契約の解約がその効力を生ずる日

2020年2月20日

### 3. 投資信託契約の解約の中止に関する条件を定めるときは、その条件

該当事項はありません。

### 4. 投資信託契約の解約に関する事項について受益者の不利益となる事実

該当事項はありません。

### 5. 財産状況開示資料等を作成した後に、重要な投資信託財産に属する財産の処分、重大な信託財産責任負担債務の負担その他の投資信託財産の状況に重要な影響を与える事象が生じたときは、その内容

該当事項はありません。

6. 直前に作成された財産状況開示資料等の内容

追加型投資信託信託財産運用状況表  
(2019年9月17日現在)

信託の名称又は回次	信託契約締結年月日	当初設定信託元本
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	2013年2月1日	7,981,759,116 円
借 方	科 目	貸 方
793,610,916 円 434,057 11,517,943 10,017 781,648,899	資 産 (A) 金銭信託 コール・ローン 親投資信託受益証券 投資信託受益証券	円
	負 債 (B) 未払受託者報酬 未払委託者報酬 その他未払費用	733,432 19,299 707,704 6,429
942,016,647  942,016,647	元 本 (C) 元本 分配準備積立金(配当等収益) 分配準備積立金(有価証券売買益) 繰越欠損金	2,043,610,751 1,895,352,236 143,369,759 4,888,756
523,952,995 -1,097 831 19,299 707,704 6,436 523,110,325 109,497	損 失 (D) 有価証券売買損 支払利息 受託者報酬 委託者報酬 その他費用 収益調整金(有価証券売買損相当額) 評価損調整勘定	
	利 益 (E) 有価証券売買益 受取配当金 受取利息 収益調整金(その他収益調整金) 評価益調整勘定	215,236,375 86,343 26,360,193 30 188,789,778 31
2,259,580,558	合 計	2,259,580,558
	貸借対照表純資産総額(A-B) (F) 有価証券評価損益 (G) 信託財産純資産総額(F+G)	792,877,484 円 -13,503,170 779,374,314
	受 益 権 総 口 数	1,895,352,236 口
	受 益 証 券 基 準 価 額	4,112 円

**追加型投資信託信託財産運用状況表**  
(2019年9月17日現在)

信託の名称又は回次	信託契約締結年月日	当初設定信託元本
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	2013年2月1日	779,008,192 円
借 方	科 目	貸 方
24,546,543 円 17,116 454,187 10,017 24,065,223	資 産 (A) 金銭信託 コール・ローン 親投資信託受益証券 投資信託受益証券	円
	負 債 (B) 未払受託者報酬 未払委託者報酬 その他未払費用	22,949 589 22,164 196
11,627,428  11,627,428	元 本 (C) 元本 分配準備積立金(配当等収益) 分配準備積立金(有価証券売買益) 繰越欠損金	39,965,649 39,288,407 640,074 37,168
4,530,402 -1 22 589 22,164 196 4,507,432	損 失 (D) 有価証券売買損 支払利息 受託者報酬 委託者報酬 その他費用 収益調整金(有価証券売買損相当額)	
	利 益 (E) 受取配当金 受取利息 収益調整金(その他収益調整金)	715,775 236,824 1 478,950
40,704,373	合 計	40,704,373
	貸借対照表純資産総額(A-B) (F) 有価証券評価損益 (G) 信託財産純資産総額(F+G)	24,523,594 円 -94,887 24,428,707
	受 益 権 総 口 数	39,288,407 口
	受 益 証 券 基 準 価 額	6,218 円

追加型投資信託信託財産運用状況表  
(2019年9月17日現在)

信託の名称又は回次	信託契約締結年月日	当初設定信託元本
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	2013年12月18日	50,000,000 円
借 方	科 目	貸 方
39,927,753 円 20,221 536,569 10,011 39,360,952	資 産 (A) 金銭信託 コール・ローン 親投資信託受益証券 投資信託受益証券	円
	負 債 (B) 未払受託者報酬 未払委託者報酬 その他未払費用	37,465 983 36,174 308
15,128,257  15,128,257	元 本 (C) 元本 分配準備積立金(配当等収益) 分配準備積立金(有価証券売買益) 繰越欠損金	55,779,809 54,190,911 763,307 825,591
5,142,266 25 983 36,174 308 5,104,776	損 失 (D) 支払利息 受託者報酬 委託者報酬 その他費用 収益調整金(有価証券売買損相当額)	
	利 益 (E) 受取配当金 受取利息 収益調整金(その他収益調整金)	4,381,002 322,455 1 4,058,546
60,198,276	合 計	60,198,276
	貸借対照表純資産総額(A-B) (F) 有価証券評価損益 (G) 信託財産純資産総額(F+G)	39,890,288 円 533,856 40,424,144
	受 益 権 総 口 数	54,190,911 口
	受 益 証 券 基 準 価 額	7,460 円

「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/為替ヘッジありコース/為替ヘッジなしコース」  
信託終了（繰上償還）に関するQ & A

**Q 1. なぜ信託終了（繰上償還）を行うのですか？**

A 1. 今般、各ファンドの主要投資対象である「AB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」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。

今後も運用資産の減少傾向が継続した場合、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すことが、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）を行うことにつき提案させていただくこととなりました。

**Q 2. 何か手続きをしなければならないのですか？**

A 2. 同封の「議決権行使書面」に信託終了（繰上償還）に対する賛否のご意向等を記載いただき、2019年11月21日（必着）までに、ニッセイアセットマネジメント株式会社までご送付ください（同封の返信用封筒をご利用ください）。

なお、お手続きをいただかない場合（「議決権行使書面」をご返送いただかない場合）は、賛成するものとさせていただきます。

**Q 3. 「書面による決議」とは何ですか？**

A 3. 書面による決議とは、受益者の皆様に信託終了（繰上償還）の賛否を問うために行うものです。各ファンドごとに、議決権を行使することができる受益者の議決権口数の3分の2以上の賛成をもって可決されます。

上記の議決権口数による賛成を得られず、本決議が否決された場合は、本手続きによる各ファンドの信託終了（繰上償還）の手続きは行いません。

なお、書面による決議は各ファンドごとに行われるため、決議の結果によっては、いずれかのファンドのみが繰上償還し、他のファンドは繰上償還しない場合があります。

**Q 4. どの時点の受益者に議決権があるのですか？**

A 4. この書面決議は、2019年10月23日時点の受益者の方を対象としています。

各ファンドともに、購入・換金の際には申込受付日の翌営業日に算出される基準価額を適用しておりますので、10月23日の前営業日となる10月21日現在で保有されている方に加えて、10月21日の申込みによって全額換金された方も対象となります。

また、購入については、10月18日までに購入の申込みをされた方が対象となります。