

2016年8月12日

「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)」
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・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)」のマンスリーレポート
の誤記載に関するお詫びと訂正

拝啓

時下ますますご清栄のこととお喜び申し上げます。平素は、弊社の投資信託をご愛顧賜り、心より御礼申し上げます。

さて、弊社が作成しております「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)」のマンスリーレポートにつきまして誤記載がございました。

受益者の皆様には深くお詫び申し上げますと共に、マンスリーレポート(2016年6月末現在)の場合を例として、下記の通りご説明させていただきます。

なお、2016年5月末現在以前のマンスリーレポートにおきましても同様の箇所が誤記載となっていたことを付記させていただきます。

今後はより一層細心の注意を払って参る所存でございますので、何卒ご理解、ご了承の程お願い申し上げます。

敬具

記

<対象の資料>

- ・マンスリーレポート:2016年1月末現在分～2016年6月末現在分の6種類

<誤記載箇所>

- ・各マンスリーレポートの2ページ目【ポートフォリオ情報】、【格付分布】、3ページ目【組入上位5銘柄】

<誤記載の内容>マンスリーレポート(2016年6月末現在)の場合
以下の丸囲み部分が訂正箇所となります。

1. 【ポートフォリオ情報】

<誤>

平均格付（証券格付）	BBB+
平均修正デュレーション	2.98年
平均最終利回り	3.27%
平均クーポン	4.97%
平均直利	4.71%
平均残存年数	3.33年

<正>

平均格付（証券格付）	BBB-
平均修正デュレーション	2.98年
平均最終利回り	3.27%
平均クーポン	4.97%
平均直利	4.71%
平均残存年数	3.33年

2. 【格付分布】

<誤>

	証券格付	発行体格付
AAA格	-	-
AA格	-	-
A格	55.8%	61.2%
BBB格	32.6%	38.8%
BB格以下	11.6%	-

<正>

	証券格付	発行体格付
AAA格	-	-
AA格	-	-
A格	4.8%	61.2%
BBB格	67.1%	38.8%
BB格以下	28.1%	-

3.【組入上位5銘柄】

<誤>

	銘柄	業種	償還日	クーポン	証券格付	発行体格付	比率
1	エンジー	公益事業	2019/06/02	3.00%	A	A	6.6%
2	Solvay Finance SA	原材料	2019/05/12	4.20%	BB+	BBB	6.5%
3	バイエル	ヘルスケア	2020/07/01	3.00%	A-	A-	6.4%
4	ドン・エナジー	公益事業	2020/11/06	3.00%	BBB+	BBB+	6.3%
5	ソシエテ ジェネラル	金融	2019/09/04	9.38%	A	A	6.1%

<正>

	銘柄	業種	償還日	クーポン	証券格付	発行体格付	比率
1	エンジー	公益事業	2019/06/02	3.00%	BBB+	A	6.6%
2	Solvay Finance SA	原材料	2019/05/12	4.20%	BB+	BBB	6.5%
3	バイエル	ヘルスケア	2020/07/01	3.00%	BBB	A-	6.4%
4	ドン・エナジー	公益事業	2020/11/06	3.00%	BBB-	BBB+	6.3%
5	ソシエテ ジェネラル	金融	2019/09/04	9.38%	BB+	A	6.1%

以上