

2022年12月14日

関係各位

野村アセットマネジメント株式会社

**新しい投資信託「野村PIMCO・トレンド戦略ファンド
Aコース(米ドル売り円買い)/Bコース(為替ヘッジなし)」を設定
～複雑さを増す投資環境における、分散投資の新たな選択肢～**

野村アセットマネジメント株式会社(CEO兼代表取締役社長:小池広靖、以下「当社」)は本日、新たな追加型投資信託「野村PIMCO・トレンド戦略ファンドAコース(米ドル売り円買い)/Bコース(為替ヘッジなし)」(以下「当ファンド」)^{※1}を設定し、運用を開始しました。当ファンドは、本日より野村証券株式会社を通じて売買が可能となります。

当ファンドは、世界各国の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を実質的な主要取引対象^{※2}とし、世界各国の債券等を実質的な主要投資対象^{※2}としています。当ファンドは、PIMCO社のグローバルに展開する投資プラットフォームを活用して、世界の各市場の相場の流れに追随することで収益を追求します。相場が上昇基調なら買い、下落基調なら売るという順張り投資の運用(トレンドフォロー型運用)を行ないます。一般的に、トレンドフォロー型運用は株式や債券といった伝統的資産との相関が比較的 low、分散投資効果が期待できます。加えて、市場が下落した際に利益の確保を目指すという特徴を持ち合わせており、市場の下落局面におけるポートフォリオのリスクを抑えることが期待できます。

当社は今後も、世界のお客様から選ばれる、日本を代表する運用会社になることを目指して、競争力のある商品・サービスを投資家の皆様に提供していきます。

^{※1} Aコースにおける「米ドル売り円買い」とは、投資する外国投資信託において、原則として純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行なうことをいいます。

^{※2} 「実質的な主要投資(取引)対象」とは、外国投資信託や「野村マネー マザーファンド」を通じて投資する、主要な投資(取引)対象という意味です。当ファンドは、外国投資信託「PIMCOバミューダ・トラストIVーPIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンド」および「野村マネー マザーファンド」を投資対象とし、ファンド・オブ・ファンズ方式で運用します。

以上

<野村アセットマネジメントからのお知らせ>

■当ファンドの投資リスク

【基準価額の変動要因】

ファンドの基準価額は、投資を行なっている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属します。したがって、ファンドにおいて、投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金が割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金と異なります。

- ・株価変動リスク: ファンドは、実質的に株式に関連するデリバティブ取引を活用しますので、株価変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の株価変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。
- ・債券価格変動リスク: 債券(公社債等)は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは、実質的に債券に投資を行ない、また実質的に債券に関連するデリバティブ取引を活用しますので、債券価格変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の債券価格の変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。
- ・商品(コモディティ)市況変動リスク: ファンドは、実質的に商品に関連するデリバティブ取引を活用すること等を通じて、商品(コモディティ)市況変動の影響を受けます。
- ・為替変動リスク
 - ・ファンドは、効率的に収益を追求する目的で為替予約取引等を実質的に活用しますので、為替変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。
 - ・「Aコース」が投資する「PIMCO バミューダ・トラスト IVーPIMCO バミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー(円ヘッジ)-リテールクラス」においては、原則として当該クラスの純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行なうことにより、米ドル建ての資産については為替変動リスクが低減しますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、米ドル建て以外の外貨建資産については、当該通貨と米ドルとの間の為替変動の影響を受けます。この場合、当該通貨が米ドルに対して安くなった場合には、基準価額が下落する要因となります。なお、円金利が米ドルの金利より低い場合、為替取引によるコスト(金利差相当分の費用)がかかるため、基準価額の変動要因となります。
 - ・「Bコース」が投資する「PIMCO バミューダ・トラスト IVーPIMCO バミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー(円ヘッジなし)-リテールクラス」においては、原則として対円での為替ヘッジを行ないませんので、為替変動の影響を受けます。
- ・代替手法に関するリスク: ファンドは、株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引等のロング・ポジション、あるいはショート・ポジションを実質的に構築することにより、実質的な投資対象市場の方向性によらず収益の獲得を目指しますので、実質的な投資対象市場が上昇した場合でも、収益が得られない場合や損失が発生する場合があります。また、レバレッジを利用して先物取引等を行なうことが可能なため、実質的な投資対象市場における値動きが、それ以上の損失をもたらす場合があります。
- ・取引先リスク: ファンドは、実質的にデリバティブ取引等を利用しますので、取引先リスク(取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる危険のこと)があります。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

*詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「投資リスク」をご覧ください。

■当ファンドに係る費用

投資者が直接的に負担する費用	
購入時手数料	購入価額※に3.3%(税抜3.0%)以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額(詳しくは販売会社にお問い合わせ、もしくは購入時手数料を記載した書面をご覧ください。)購入時手数料は、商品及び関連する投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務コストの対価として、購入時に頂戴するものです。 ※ 購入申込日の翌営業日の基準価額
信託財産留保額	ありません

投資者が信託財産で間接的に負担する費用				
運用管理費用 (信託報酬)	信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に信託報酬率を乗じて得た額とします。ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。 信託報酬率の配分は下記の通りとします。			
	信託報酬率		年1.012%(税抜年0.92%)	
	おおよび 役務の内容 支払先の 配分(税抜)	委託会社	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等	年0.25%
		販売会社	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等	年0.65%
		受託会社	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等	年0.02%
	投資対象とする外国投資証券の信託報酬率		年1.25%	
実質的な負担(注)		年2.262%程度(税込)		
(注)ファンドが投資対象とする外国投資信託の信託報酬を加味して、投資者が実質的に負担する信託報酬率について算出したものです。				
その他の費用・手数料	その他の費用・手数料として、以下の費用等がファンドから支払われます。これらの費用等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。 ・組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料 ・監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ・ファンドに関する租税 等			

上記の費用の合計額については、投資家の皆様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。

※ 詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「ファンドの費用・税金」をご覧ください。

■当資料について

当資料は、ファンドのご紹介を目的として野村アセットマネジメントが作成したものです。

当資料は信頼できると考えられる情報に基づいて作成しておりますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。

当資料中の記載事項は、すべて当資料作成時のものであり、事前の連絡なしに変更されることがあります。

当資料中のいかなる内容も将来の投資収益を示唆あるいは保証するものではありません。

商 号: 野村アセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第373号

加入協会: 一般社団法人投資信託協会/一般社団法人日本投資顧問業協会/

一般社団法人第二種金融商品取引業協会