

2022年4月26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「ダブル・ブレイン・コア(マイルド/スタンダード/ブル)」を設定 ～2つの戦略を組み合わせ、市場の様々な局面での収益獲得に貢献～

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「ダブル・ブレイン・コア(マイルド/スタンダード/ブル)」(以下「当ファンド」)を設定し、運用を開始しました。本日から当ファンドの各販売会社が取扱いを開始します。

当ファンドは、新興国を含む世界各国の株式、債券、商品等、多様な市場を投資対象^{※1}とし、高度な数学を用いて市場データ等を分析し構築したモデルに基づくクオンツ運用で有名な、英国マン・グループ傘下のAHL Partners LLP(AHL パートナーズ LLP)が運用する2つの戦略を組み合わせます。世界の資産の成長を捉えながら、相場の異変時には投資配分を素早く変更することで、資産価格の大幅な下落を抑制し、市場のさまざまな局面での収益獲得を図ります。当ファンドの売買執行などの運用の一部においては、AI(人工知能)や機械学習を活用します。なお、類似戦略の追加型投資信託「ダブル・ブレイン」^{※2}は、過去のパフォーマンスが評価され、アワード受賞^{※3}の実績があります。

当ファンドは、リスク水準の異なる3種(マイルド/スタンダード/ブル)から、お客様のニーズに合わせて選ぶことが可能^{※4}です。

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 世界各国の株式、債券、商品等に関連する流動性の高いデリバティブ取引、為替予約取引等を実質的な主要取引対象とし、債券等を実質的な主要投資対象とします。「実質的な」とは、外国投資法人や「野村マネーインベストメント マザーファンド」を通じて投資する、という意味です。

※2 類似戦略の「ダブル・ブレイン」は、現在、運用資産規模を適正な範囲内に維持するため、新規のお買付け等各種お申込みの受け付けを一時停止しています。

※3 2022年2月10日付ご参考資料「モーニングスター “ファンド オブ ザ イヤー2021”『優秀ファンド賞』受賞」、2021年2月1日付ご参考資料「モーニングスター “ファンド オブ ザ イヤー2020”『最優秀ファンド賞』受賞」をご参照ください。

https://www.nomura-am.co.jp/news/20220210_doublebrain.pdf

http://www.nomura-am.co.jp/news/20210201_30E0D082.pdf

※4 販売会社によっては、一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。

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へ帰属します。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、為替変動リスクの低減を図る目的(ヘッジ目的)のほか、効率的に収益を追求する目的(ヘッジ目的外)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。

・代替手法に関するリスク: ファンドは、株式、債券、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。
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、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および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。				
	ファンド名		マイルド	スタンダード	ブル
	信託報酬率		年0.858% (税抜年0.78%)		
	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0.50%	
		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0.03%	
	投資対象とする外国投資証券の信託報酬率		年 0.77%	年 1.07%	年 1.45%
実質的な負担(注)		年 <u>1.628%</u> 程度 (税込)	年 <u>1.928%</u> 程度 (税込)	年 <u>2.308%</u> 程度 (税込)	
(注)ファンドが投資対象とする外国投資証券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。

※販売会社によっては、一部のファンドのみのお取り扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

■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。

上記受賞は過去の一定期間の実績が評価されたものであり、将来の運用成果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