

JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社
〒100-6432
東京都千代田区丸の内2丁目7番3号東京ビルディング

プレスリリース

報道機関 各位

JPモルガン・アセット・マネジメント グローバル高利回りCBファンドの第四弾を提供

〔東京 2012年7月2日〕

JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社（所在地：東京都千代田区、社長：猪股伸晃）は、本日、「JPMグローバル高利回りCBファンド 2012-08」の募集を7月17日より開始すると発表しました。当ファンドは、申込期間を7月17日から8月6日、設定日を8月7日とする期間約3年の単位型投資信託であり、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社が販売されます。

「JPMグローバル高利回りCBファンド 2012-08」は、「JPMグローバル高利回りCBファンド 2011-12」、「JPMグローバル高利回りCBファンド 2012-01」、「JPMグローバル高利回りCBファンド 2012-02」に続く、グローバル高利回りCBファンドの第四弾として設定されます。第三弾までのファンドと同様、日本を除く世界各国の転換社債（CB）市場で、相対的に利回りが高いと判断されるCBに投資を行うことで収益を追求する単位型投信であり、為替については原則ヘッジを行います。

債券的な性格が強く、相対的に利回りが高いCBへの投資機会を提供

「JPMグローバル高利回りCBファンド 2012-08」は、債券的性格の強いCBに着目して投資を行うファンドです。債券的性格が強いCBは、一般的に、CB価格の下値抵抗力が期待でき、利回りが相対的に高い傾向にあります。当ファンドは、その中でも信用リスクと比較して利回りが高いCBを厳選して投資します。

CBは債券としての性格を有するため、価格が額面を割り込んだCBは、発行体が倒産しない限り、発行体の信用力が回復もしくは満期が近づくにつれて、徐々に価格が額面に向けて上昇していくことが期待されます。そのため、信用不安の高まりなどによりCBの価格が下落した局面は、魅力的な投資機会であると考えられます。引き続き市場が不安定な中、当ファンドでは、価格の下落によって割安度合いが高まっているCBを中心に投資していきます。

運用体制

「JPモルガン・アセット・マネジメント」グループは、世界の様々な国の市場動向についての専門知識と各国に根ざした企業調査を駆使して、長期にわたって日本および世界の投資家に世界のCB投資の機会を提供し続けています。「JPMグローバル高利回りCBファンド 2012-08」も、当社グループの一員であるJPモルガン・アセット・マネジメント（UK）リミテッドが運用を行います。

当社は、第四弾となる「JPMグローバル高利回りCBファンド 2012-08」を通じて、当社グループのグローバル・ネットワークを最大限活用しながら、グローバル高利回りCBへの投資機会をさらに多くの個人投資家に提供すべく尽力してまいります。

（ファンドの概要については、添付の商品概要をご参照下さい）

* * *

JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社は、日本市場に最も早く進出した外資系資産運用会社のひとつです。日本の金融業界の規制緩和と共に1987年に投資一任契約業務の認可取得、外資系資産運用会社の第一陣として、1990年に投資信託委託会社を設立し、また公的年金基金の運用委託など業界の先駆けとなっています。投資家の多様化するニーズに対応すべく、株式、債券、転換社債、オルタナティブ投資等、あらゆる資産クラスにおいて卓越した運用能力を発揮し、リーディングカンパニーならではの資産運用サービスを提供します。

「JPモルガン・アセット・マネジメント」グループはJPモルガン・チェース・アンド・カンパニー傘下の資産運用部門です。国際的な資産運用の分野で140年以上にわたる実績があり、運用総資産残高約1兆3,362億米ドル(約103兆円)*を有する世界最大規模の資産運用サービスグループです。世界41拠点到ネットワークを持ち、日本ではJPモルガン・アセット・マネジメント株式会社を通じて顧客にサービスを提供しています。

JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー(NYSE: JPM)は、世界60カ国以上**に拠点をもち、総資産2.3兆ドル**を有する世界有数の金融サービス会社です。投資銀行業務、個人向け金融サービス、中小企業向け銀行業務、コマーシャル・バンキング業務、金融取引管理事務業務、資産運用業務、プライベート・エクイティ業務において業界をリードしています。JPモルガン・チェースは、ダウ・ジョーンズ工業株平均の構成銘柄として採用されており、法人向けの「J.P.モルガン」、および個人向けの「チェース」のブランドの下で、世界有数の事業法人・機関投資家・政府機関、並びに米国の個人のお客様に金融サービスを提供しています。JPモルガン・チェースの情報はwww.jpmorganchase.comにてご覧いただけます。

数値は2011年12月末現在

*1米ドル= 76.94円で換算

**2012年3月末現在

商品概要

ファンド名	JPMグローバル高利回りCBファンド 2012-08
商品分類	単位型投信／海外／その他資産(転換社債)
ファンドの目的	世界各国(日本を除く)のCB(転換社債)を主要投資対象として運用を行い、信託財産の安定的な収益を確保し、かつ信託財産の着実な成長をはかることを目的とします。
為替ヘッジ	外貨建資産については、為替ヘッジを行うことにより、為替変動による影響を抑えます。
ベンチマーク	ありません。
運用の外部委託先	JPモルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッド(英国法人)に運用を委託します。
購入価額	1口当たり1万円とします。購入価額には購入時手数料が含まれます。
換金価額	換金申込日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた額とします。換金時に手数料はかかりません。
購入の申込期間	2012年7月17日から2012年8月6日まで
購入・換金申込受付の中止及び取消し	以下の事情により基準価額が確定できない場合は、換金申込みの受付を中止することがあり、また既に受け付けられた換金申込みの取消しができることがあります。 ・有価証券取引市場における取引の停止 ・外国為替取引の停止 ・その他やむを得ない事情
設定日	2012年8月7日
信託期間	2012年8月7日から2015年8月6日(休業日の場合は翌営業日)まで
決算日	毎年8月6日(休業日の場合は翌営業日)です。 毎年1回の決算時に、委託会社が分配額を決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。
購入時手数料	手数料は1口につき315円(税抜300円)を上限とします。購入時手数料は購入価額に含まれています。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
信託財産留保額	換金申込日の翌営業日の基準価額に対して1.0%を乗じて得た額が換金時に差し引かれます。
運用管理費用(信託報酬)	純資産総額に対して年率1.6275%(税抜1.55%)がかかります。
販売会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社

本資料に掲載されている当社各ファンドのご投資の際のリスクについて

JPMグローバル高利回りCBファンド 2011-12、JPMグローバル高利回りCBファンド 2012-01、JPMグローバル高利回りCBファンド 2012-02、JPMグローバル高利回りCBファンド 2012-08(以下、「4ファンド」または「ファンド」といいます。)は、世界各国(日本を除く)のCB(転換社債)を主な投資対象とし、また、その他の外貨建資産を保有することがありますので、金利の変動、株式市場、為替相場、その他の市場における価格の変動により、保有している有価証券等の価格が下落した場合、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、外貨建資産に対して為替ヘッジを行います。が、為替変動リスクを完全にヘッジすることはできませんので、為替の変動により損失を被ることがあります。

ファンドの主なリスク(4ファンド共通)

ファンドの運用による損益はすべて投資者に帰属します。投資信託は元本保証のない金融商品です。投資信託は預貯金と異なります。

ファンドは、主に世界各国(日本を除く)のCBIに投資しますので、以下のような要因の影響により基準価額が変動し、下落した場合は、損失を被ることがあります。下記は、ファンドにおける基準価額の変動要因のすべてではなく、他の要因も影響することがあります。

- 株価変動リスク
株式の価格は、政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況の変化、市場における需給・流動性による影響を受け、変動することがあります。CBの価格は、転換先株式の価格変動の影響を受けるため、株式と同様の要因により、変動することがあります。
- 信用リスク
CBの発行体の財務状況の悪化や倒産、所在する国家の政情不安等により、元本・利息の支払いが遅れたり、元本・利息が支払えない状態になった場合、またはそれが予想される場合には、当該CBの価格が変動・下落することがあります。
- 金利変動リスク
金利の変動がCBの価格に影響を及ぼします。一般に、金利が上昇した場合には、CBの価格が下落します。
- 為替変動リスク
為替相場の変動が投資資産の価値の変動に影響を与えることがあります。ファンドは、為替ヘッジを行います。ヘッジを行った場合でも為替変動リスクを完全にヘッジすることはできません。
- 流動性リスク
CBは市場での売買高が少ない場合があり、注文が成立しないこと、売買が成立しても注文時に想定していた価格と大きく異なることがあります。

ファンドの諸費用について(4ファンド共通)**直接的に負担する費用**

- ◎購入時手数料 1口につき315円(税抜300円)
購入時手数料は購入価額に含まれております。
- ◎信託財産留保額 換金申込日の翌営業日の基準価額に対して1.0%を乗じて得た額が換金時に差し引かれます。

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) 純資産総額に対して年率1.6275%(税抜1.55%)
- ◎その他費用・手数料
 - ・有価証券の取引等にかかる費用*
 - ・外貨建資産の保管費用*
 - ・信託財産に関する租税*
 - ・信託事務の処理に関する諸費用、その他ファンドの運用上必要な費用*
 - ・純資産総額に対して年率0.021%(税抜0.02%)をファンド監査費用とみなします。ただし、年間315万円(税抜300万円)を上限とします。

* ファンドの運用状況、保有銘柄、投資比率等により変動し、また銘柄ごとに種類、金額および計算方法が異なっておりその概要を適切に記載することが困難なことから、具体的に記載しておりません。さらに、その合計額は、受益者がファンドの受益権を保有する期間その他の要因により変動し、表示することができないことから、記載しておりません。

費用等の合計額は、ファンドの保有期間等により変動し、表示することができないことから、記載しておりません。

詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

本資料はJPモルガン・アセット・マネジメント株式会社(以下、「当社」という。)が作成したものです。当社は信頼性が高いとみなす情報等に基づいて本資料を作成しておりますが、当該情報が正確であることを保証するものではなく、当社は、本資料に記載された情報を使用することによりお客さまが投資運用を行った結果被った損害を補償いたしません。本資料に記載された意見・見通しは表記時点での当社の判断を反映したものであり、将来の市場環境の変動や、当該意見・見通しの実現を保証するものではありません。また、当該意見・見通しは将来予告なしに変更されることがあります。本資料は、当社が設定・運用する投資信託について説明するものであり、その他の有価証券の勧誘を目的とするものではありません。また、当社が当該投資信託の販売会社として直接説明するために作成したものではありません。

投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入のお客さまが負います。過去の運用成績は将来の運用成果を保証するものではありません。投資信託は、預金等や保険契約と異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。投資信託を証券会社(第一種金融商品取引業者を指します。)以外でご購入いただいた場合、投資者保護基金の保護の対象ではありません。投資信託は、金融機関の預金と異なり、元本および利息の保証はありません。取得のお申し込みの際は投資信託説明書(交付目論見書)をあらかじめまたは同時に御渡しますので必ずお受け取りの上、内容をご確認下さい。最終的な投資判断は、お客さまご自身の判断でなさるようお願いいたします。

◆投資信託委託会社

JPモルガン・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330号

加入協会: 日本証券業協会、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

目論見書の入手先は、こちらでご確認いただけます。 www.jpmorganasset.co.jp