

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 日本初の当日買付・当日解約が可能な法人向けファンドを設定

〔東京 2012年9月28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 日本国債ファンド(日々決算型)」を 2012 年 10 月 12 日に設定すると発表しました。当ファンドは、日本初^{*1}の当日買付および当日解約が可能なファンドで、販売会社である JP モルガン証券株式会社を通じて法人向けに販売されます。基準価額を一定に維持する仕組み^{*2}で、日本国債等に投資対象を限定した法人向けファンドとしても日本初となります。

この日本初のファンドは、元本の安定性、流動性を備えつつ、競争力のある利回りを目指します。高い信用力を維持し、預金からの代替として活用しやすい商品を求める投資家に最適なファンドです。「JP モルガン・アセット・マネジメント」グループの実績に裏打ちされた与信管理・投資プロセスを基盤として運用される当ファンドを保有することにより、投資家は、日本国債に限定されたポートフォリオへの分散投資を図ることができます。当ファンドは日本における公募の投資信託であり、国内投資家のほか、一部の海外投資家が購入可能となります。

当社グループのグローバル・リクイディティ部門アジア地域を統括するトラビス・スペンスは、次のように述べています。「円資金を運用する法人顧客の皆様は、常に、より安全で、より流動性の高い商品を求めています。『JP モルガン・アセット・マネジメント』グループは、これまでアジア各国でそうした顧客ニーズに合う商品をいち早く開発してまいりました。国債に投資するタイプのファンドは他の先進国でも既に好評を博しており、日本の投資家の皆様にとっても、この新ファンドは、預金以外の商品への第一歩を踏み出す上で理想的な商品になると考えています」。

当ファンドは、主に国内の短期有価証券や政府保証付の金融商品に投資します。現時点では、日本国債、国庫短期証券、国債を担保とした現先・レポ、国債を担保とした有担コール、政府保証債等への投資を予定しています。

当社グループのグローバル・リクイディティ部門を統括するロバート・ドイチェは、次のようにコメントしています。「グローバル・リクイディティ部門は、アジアで 2004 年から、また日本で 2007 年から法人向けにマネー・マーケット・ファンドビジネスを展開しています。国内で唯一トリプル A のファンド格付けを有する『JP モルガン円建てキャッシュ・リクイディティ・ファンド』の提供を通じて、既に日本でもマネー・マーケット・ファンド運用会社大手の一角に名を連ねています。『JPM 日本国債ファンド(日々決算型)』の設定は、アジアでも最重要市場の一つである日本における、非常に革新的な展開と位置づけられます」。

「JP モルガン・アセット・マネジメント」グループは、短期証券等の運用資産残高約 4,930 億ドル^{*3}を有する世界最大級のマネー・マーケット・ファンドの運用会社です。

※ 当ファンドおよび JP モルガン円建てキャッシュ・リクイディティ・ファンドは法人向けの商品であり、個人投資家はご購入いただけません。

^{*1} 当社調べ、2012 年 9 月 25 日現在

^{*2} 毎日決算を行い、1 口当たり 1 円として設定・解約を行います。

^{*3} 2012 年 6 月 30 日現在

* * *

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1兆3,815億米ドル(約113兆円)*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拠点に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**に拠点を持ち、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2012年3月末現在

*1米ドル= 82.30円で換算

**2012年6月末現在

ファンドの主なリスクおよび留意点

当ファンドは、日本の国債等を投資対象としますので、組入有価証券の価格の下落、組入有価証券の発行会社の財務状況の悪化や倒産等の影響により、基準価額が下落し損失を被ることがあります。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。当ファンドに生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。当ファンドは預貯金と異なります。当ファンドが有する主なリスク等は以下のとおりです。なお、以下の説明は、全てのリスクについて記載したのではなく、それ以外のリスクも存在することがあります。

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。

基準価額の変動要因

ファンドは、日本の国債等に投資しますので、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。

- 信用リスク
有価証券の発行体の財務状況の悪化や倒産等により、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、当該有価証券の価格が変動・下落することがあります。
コール・ローン、現先取引等の取引を行う相手方の財務状況の悪化や倒産等により、債務不履行が起こった場合には、当該取引にかかる資産の回収が遅れたり、その全部または一部が回収できないことがあります。
- 金利変動リスク
金利の変動が有価証券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、有価証券の価格が下落します。
- 流動性リスク
急激かつ大量の売買により市場が大きな影響を受けた場合、または市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、機動的に有価証券を売買できないことがあります。そのような場合、またはそれが予想される場合には、当該有価証券の価格が変動・下落することがあります。

上記は、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。

ファンドの諸費用について

以下の費用を投資者にご負担いただきます。

投資者が直接的に負担する費用	
購入時手数料	かかりません。
信託財産留保額	かかりません。
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)	<p>日々終了時点の信託元本総額に対し、<u>信託報酬率上限(年率)</u>以下で、信託元本総額および収益の状況に応じて各週の最初の営業日(以下「信託報酬率決定日」といいます。))に委託会社が所定の基準に従い決定する率(以下「信託報酬率」といいます。))を乗じて得た額とします。信託報酬率は、信託報酬率決定日からその翌週以降の最初の営業日の前日まで同一のものを適用します。ただし、設定日からその翌々週の最初の営業日の前日までにおける信託報酬率は、<u>年率0.01%(税抜)</u>とします。</p> <p>(信託報酬率上限について)</p> <p>信託報酬率決定日の前日までの連続する過去7暦日間における、受益権1万口当たりの未払収益分配金、信託報酬計上額および諸経費計上額の合計額の平均値(小数点以下第4位未満切捨)に365を乗じ、10,000で除したものを百分率で表記した年換算収益分配率(小数点以下第4位未満切捨)の50%(小数点以下第4位未満切捨、税抜)を上限とします。ただし、<u>年率0.2%(税抜)</u>を超えないものとします。</p> <p>信託財産に日々費用計上し、原則として毎月の最終営業日に1ヵ月分(前月の最終営業日から当月の最終営業日の前日までの各計算期間に相当する分)をまとめて、信託財産中から支払うものとします。ただし、信託終了の場合はその日の翌営業日に信託終了までの計上額のうち支払われていない額をまとめて支払うものとします。</p>
その他の費用・手数料	<p>1 以下の費用等が認識された時点で、ファンドの計理基準に従い、信託財産に計上されます。ただし、間接的にファンドが負担するものもあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・有価証券の取引等にかかる費用(その相当額が取引価格に含まれている場合があります。) ・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 <p>(注)上記1の費用等は、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。</p> <p>2 信託元本総額に対し、年率0.0000105%(税抜0.00001%)をファンド監査費用とみなし、そのみなし額を信託財産に日々計上します。ただし、年間315万円(税抜300万円)を上限とします。</p> <p>なお、上記1・2の費用等の詳細は、請求目論見書で確認することができます。</p>

(注)上記における「税」および「消費税等」は、消費税および地方消費税相当額です。

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及び当社グループ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お渡し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