

2016年9月15日

「新生・世界スマート債券ファンド」受益者の皆様へ

新生インベストメント・マネジメント株式会社

「新生・世界スマート債券ファンド」の月次レポートにおける
記載内容の一部訂正のお知らせとお詫び

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

さて、弊社が作成しております「新生・世界スマート債券ファンド」の2016年4月～6月末時点月次レポートにおきまして、内容の一部に誤りがございました。

受益者の皆様には深くお詫び申し上げます。

訂正箇所に関する詳細につきましては、下記をご参照いただきますようお願いいたします。

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

<対象ファンド>

新生・世界スマート債券ファンド 1409
新生・世界スマート債券ファンド 1502
新生・世界スマート債券ファンド 1506
新生・世界スマート債券ファンド 1511

新生・世界スマート債券ファンド 1411
新生・世界スマート債券ファンド 1503
新生・世界スマート債券ファンド 1508

※ 以下、これら対象ファンドが投資しているケイマン籍外国投資信託「ニッポン・オフショア・ファンズー世界スマート債券ファンド」を「投資先ファンド」といいます。

<2016年4月～6月末時点の月次レポート>

訂正箇所ならび訂正内容は以下の通りです。

●2 ページ目上段【組入状況】の右側の表中

月次レポートの基準日	項目	訂正後	訂正前
2016年4月28日	平均最終利回り	1.90%	2.06%
	平均最終利回り(円ヘッジ)	1.42%	1.58%
2016年5月31日	平均最終利回り	1.77%	2.16%
	平均最終利回り(円ヘッジ)	1.25%	1.64%
2016年6月30日	平均最終利回り	1.68%	2.08%
	平均最終利回り(円ヘッジ)	1.16%	1.56%

(以下、次葉)

上記項目を含め、当ファンドの月次レポート2ページ目には、投資先ファンドの副投資運用会社であるスタンディッシュ・メロン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー(以下「スタンディッシュ社」といいます)社が算出したデータを投資運用会社である BNY メロン・アセット・マネジメント・ジャパンから入手して掲載しています。今般の訂正は、スタンディッシュ社において本来は利回りの算出対象としていない金融資産を含めた方法で算出されたデータが提供されたことにより発生いたしました。

弊社は、投資運用会社である BNY メロン・アセット・マネジメント・ジャパンに対して、同社とスタンディッシュ社間で提供されるデータの妥当性についてより精緻に検証・協議・確認を行う態勢を構築するよう要請致しました。また、弊社におきましては、両社間のチェック機能が有効であることをモニタリングし、弊社内においてもより慎重なデータチェックを行うことで再発防止に努める所存です。

以上