

【表紙】

【提出書類】 臨時報告書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 2024年5月10日提出

【ファンド名】 ニッセイ／TCW債券戦略ファンド（3ヵ月決算型・為替ヘッジあり）
ニッセイ／TCW債券戦略ファンド（3ヵ月決算型・為替ヘッジなし）

【発行者名】 ニッセイアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 大関 洋

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号

【事務連絡者氏名】 投資信託業務部 茶木 健

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号

【電話番号】 03 - 5533 - 4608

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1 【臨時報告書の提出理由】

契約型追加型証券投資信託「ニッセイ／TCW債券戦略ファンド（3ヵ月決算型・為替ヘッジあり）」「ニッセイ／TCW債券戦略ファンド（3ヵ月決算型・為替ヘッジなし）」につき、金融商品取引法第24条の5第4項に基づく特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令第29条第2項第4号の規定に従い信託財産の計算に関する書類として本臨時報告書を提出するものです。

2 【報告内容】

ニッセイ／TCW債券戦略ファンド（3ヵ月決算型・為替ヘッジあり）

| 計 算 期 間 | 第25期 | |
|------------------------|------|------------|
| | 自 | 2024年1月23日 |
| | 至 | 2024年4月22日 |
| 収益分配金 （1万口当り、税込み） | | 30円 |
| 期末純資産総額 | | 10,051千円 |
| 期末受益権口数 | | 1,202万口 |
| 期末基準価額 （1万口当り、分配落後） | | 8,361円 |

ニッセイ／TCW債券戦略ファンド（3ヵ月決算型・為替ヘッジなし）

| 計 算 期 間 | 第25期 | |
|------------------------|------|------------|
| | 自 | 2024年1月23日 |
| | 至 | 2024年4月22日 |
| 収益分配金 （1万口当り、税込み） | | 45円 |
| 期末純資産総額 | | 2,804千円 |
| 期末受益権口数 | | 205万口 |
| 期末基準価額 （1万口当り、分配落後） | | 13,669円 |