

【表紙】

【提出書類】 臨時報告書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 2025年1月15日提出

【ファンド名】 ニッセイ日経225高値参照型アロケーションファンド

【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【提出理由】

契約型追加型証券投資信託「ニッセイ日経225高値参照型アロケーションファンド」（以下「当ファンド」といいます）について、信託終了（繰上償還）にかかる手続きを開始することを決定しましたので、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14号の規定にしたがい本臨時報告書を提出するものです。

2【報告内容】

イ．信託終了（繰上償還）の年月日

2025年4月10日（予定）

書面決議が可決された場合、信託を終了（繰上償還）します。

ロ．信託終了（繰上償還）にかかる決定に至った理由

当ファンドは設定以来、日経平均株価の最高値からの下落率を参照し、下落局面で国内株式の組入比率を引上げ、その後の上昇局面での組入比率を引下げることで、信託財産の中長期的な成長をめざし運用を行ってまいりました。

しかしながら、運用期間中は株価上昇トレンドが続き、株式の組入比率を抑えた運用を行った局面が多く、日経平均株価（配当込み）にパフォーマンスが劣化する状況が続いたこともあり、当ファンドの運用資産残高は2024年10月末時点で約0.75億円、そして受益権口数は約0.48億口と、低位に推移している状況にあります（信託約款第45条に定める繰上償還条項である「受益権の口数が30億口または純資産総額が30億円」も大きく下回った状況）。

弊社としましても、これまで取扱販売会社の拡大や残高の積上げに向けて取り組んでまいりましたが、今後、運用資産残高の大幅な増加は見込み難く、効率的な運用を維持していくことは困難であり、当ファンドの運用を終了させ、お預かりしている運用資産をお返しすることが受益者の皆様にとって最善であると判断し、信託終了（繰上償還）のご提案をさせていただくことといたしました。

ハ．信託終了（繰上償還）に関する情報の受益者への提供または公衆縦覧

2025年1月16日現在の当ファンドの知っている受益者を対象とし、書面による決議を行うため、書面決議の日および投資信託契約の解約の理由等の事項を記載した書面決議の通知を発送します。