



ALLIANCEBERNSTEIN®

アライアンス・バーンスタイン株式会社

〒100-0011

東京都千代田区内幸町二丁目1番6号

日比谷パークフロント14階

TEL: 03-5962-9000(代)

www.alliancebernstein.co.jp

ニュースリリース

2022年7月22日

アライアンス・バーンスタイン・M&Aプレミアム(為替ヘッジあり) アライアンス・バーンスタイン・M&Aプレミアム(為替ヘッジなし) 新規設定のお知らせ

【東京-2022年7月22日】 アライアンス・バーンスタイン株式会社(東京都千代田区、代表取締役社長: 阪口和子)は、2022年7月22日に、アライアンス・バーンスタイン・M&Aプレミアム(為替ヘッジあり)およびアライアンス・バーンスタイン・M&Aプレミアム(為替ヘッジなし)を新規に設定しました(販売会社: SBI証券株式会社、楽天証券株式会社)。当ファンドは、公表された企業のM&A(合併および買収)案件等において、買収の公表と成立の間で発生する価格差(スプレッド)を収益の源泉として運用を行う“オルタナティブ(代替)投資”の一角となります。

近年、機関投資家の中で新たな投資先として欠かせない存在になりつつある“オルタナティブ投資”を、個人投資家の皆様にもご提供するために、当ファンドを新規設定することとしました。個人投資家の皆様に向け、独自のルールに基づき緻密なリスク管理を行うなど、再現性および透明性の高いシステムティックな投資プロセスを採用しています。

当ファンドを通じて、より多くのお客様の資産形成のサポートができるよう、引き続き尽力して参ります。

アライアンス・バーンスタイン・
M&Aプレミアム
(為替ヘッジあり)
(為替ヘッジなし)
追加型投信/内外/株式



ALLIANCEBERNSTEIN®

アライアンス・バーンスタイン株式会社

〒100-0011

東京都千代田区内幸町二丁目1番6号

日比谷パークフロント14階

TEL: 03-5962-9000(代)

www.alliancebernstein.co.jp

アライアンス・バーンスタインについて

アライアンス・バーンスタイン(以下、「AB」)は、世界各国において、機関投資家や個人投資家、個人富裕層に対して、高品質のリサーチと広い範囲にわたる資産運用サービスを提供する世界有数の資産運用会社です。運用プロフェッショナル546名(2022年3月末現在)を擁し、様々な資産運用サービスを世界26カ国で提供しています。2022年3月末現在の運用資産総額は約89.3兆円です。ABには、アライアンス・バーンスタイン・エル・ピーとその傘下の関連会社を含みます。アライアンス・バーンスタイン・ホールディング・エル・ピーはニューヨーク証券取引所に上場しています。

アライアンス・バーンスタイン株式会社について

アライアンス・バーンスタイン株式会社は、ABの日本拠点です。1986年の拠点開設以来、個人投資家や機関投資家向けに投資信託や年金運用などの投資サービスを提供しています。2022年3月末現在の運用資産総額は約6兆3,931億円です。より詳しい情報は、<https://www.alliancebernstein.co.jp/>をご覧ください。

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第303号

加入協会: 一般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 / 日本証券業協会 /

一般社団法人第二種金融商品取引業協会

<ご留意事項>

当資料は、ニュースリリースとしてアライアンス・バーンスタイン株式会社が作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。また、勧誘を目的に使用することはできません。当資料の内容は作成時点のものであり、将来予告なく変更することがあります。当資料は、信頼できると判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。

お問い合わせ先:

アライアンス・バーンスタイン株式会社 マーケティング・コミュニケーション部

本間 康之(ほんま やすゆき) / 中根 渉(なかね わたる)

TEL: 03-5962-9135



ALLIANCEBERNSTEIN®

アライアンス・バーンスタイン株式会社

〒100-0011

東京都千代田区内幸町二丁目1番6号

日比谷パークフロント14階

TEL: 03-5962-9000(代)

www.alliancebernstein.co.jp

アライアンス・バーンスタイン・M&A プレミアム (為替ヘッジあり)(為替ヘッジなし)

ファンドの特色

1. 主要投資対象ファンド*への投資を通じて、日本を含む世界の株式等を対象に投資します。

*各ファンドの主要投資対象ファンド

(為替ヘッジあり)

ルクセンブルグ籍円建外国投資信託受益証券「アライアンス・バーンスタイン・ファンド IIIマージャー・アービトラージ クラスS1J

JPY Hシェアーズ(為替ヘッジあり)」

(為替ヘッジなし)

ルクセンブルグ籍円建外国投資信託受益証券「アライアンス・バーンスタイン・ファンド IIIマージャー・アービトラージ クラスS1J

シェアーズ(為替ヘッジなし)

2. 公表された M&A(企業の合併および買収) 案件等において、買収の公表と成立との間で発生する価格差(スプレッド)を収益の源泉とします。
3. 主要投資対象ファンドの運用は、アライアンス・バーンスタイン・エル・ピーが行います。
4. 当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。
5. 為替ヘッジの有無が異なる2つのファンドからお選びいただけます。

分配方針

原則として、毎決算時(毎年2月7日および8月7日。休業日の場合は翌営業日)に、以下の方針に基づき分配します。(初回決算日:2023年2月7日)

- ・ 分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ・ 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、将来の収益分配金の支払いおよび金額について保証するものではなく、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないこともあります。

投資リスクについて

当ファンドは、主として投資対象ファンドを通じて、値動きのある金融商品等に投資しますので、組入れられた金融商品等の値動き(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)により基準価額は変動し、投資元本を割り込むことがあります。したがって、元金が保証されているものではありません。当ファンドの運用による損益は全て投資者に帰属します。投資信託は預貯金と異なります。

【株価変動リスク】

一般に株価は経済・政治情勢や発行企業の業績等の影響を受け変動しますので、主要投資対象ファンドが組入れる株式の株価が変動し、損失を被るリスクがあります。

当ファンドは、主要投資対象ファンドを通じて、日本を含む世界の株式等に投資しますが、公表された M&A(企業の合併および買収) 案件等において、買収の公表と成立との間で発生する価格差を収益の源泉としているため、当該組入株式等に関して、M&Aが不成立になった場合や、M&Aに関する条件の変更等で株価が変動した場合、損失を被るリスクがあります。

【デリバティブリスク】

デリバティブ取引と呼ばれる各種金融派生商品(先物取引、先渡取引、各種スワップ取引等)の活用は、当該派生商品価格が、その基礎となる資産、利率、指数等の変動以上の値動きをすることがあるため、損失を被る



ALLIANCEBERNSTEIN®

アライアンス・バーンスタイン株式会社

〒100-0011

東京都千代田区内幸町二丁目1番6号

日比谷パークフロント14階

TEL: 03-5962-9000(代)

www.alliancebernstein.co.jp

リスクがあります。また、当ファンドでは、レバレッジを利用してデリバティブ取引を行うことが可能なため、実質的な投資対象市場における値動きがそれ以上の損失をもたらす場合があります。

【為替変動リスク】

(為替ヘッジあり)

主要投資対象ファンドにおいて、原則として主要投資対象ファンドの純資産総額を米ドル換算した額と同程度程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、円に対する米ドルの為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではなく、為替相場の影響を受ける場合があります。また対象通貨国と日本の金利差によってはヘッジ・コストが収益力を低下させる可能性があります。

(為替ヘッジなし)

実質外貨建資産に対し原則として対円での為替ヘッジを行いませんので、基準価額は為替相場の変動の影響を受けます。

【信用リスク】

投資対象金融商品等の発行体が経営不安や倒産等に陥った場合に資金回収ができなくなるリスクや、それが予想される場合にその金融商品等の価格下落で損失を被るリスクがあります。

また、金融商品等の取引相手方に債務不履行が生じた場合等には、損失を被るリスクがあります。

【カントリー・リスク】

発行国の政治・経済・社会情勢の変化で金融・証券市場が混乱し、金融商品等の価格が大きく変動する可能性があります。一般に新興国市場は、市場規模、法制度、インフラなどが限定的なこと、価格変動性が大きいこと、決済の効率性が低いことなどから、リスクが高くなります。

【流動性リスク】

市場規模や取引量が限られる場合などに、機動的に金融商品等の取引ができない可能性があり、結果として損失を被るリスクがあります。

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

その他の留意点

- ・ 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。
- ・ 当ファンドは、M&A関連銘柄を実質的な主要投資対象とすることから比較的銘柄数が限定されるため、より多くの銘柄に分散投資する場合と比べて、市場全体の動きとファンドの基準価額の動きが大きく異なる場合があります。また、当ファンドは、主要投資対象ファンドを通じて、日本を含む世界の株式等に投資しますが、公表されたM&A(企業の合併および買収)案件等において、買収の公表と成立との間で発生する価格差を収益の源泉としているため、市場全体が大きく上昇した場合でも、組入銘柄の株価は買収成立価格以上になる可能性が低く、収益が限定される場合があります。
- ・ 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・ 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金のお申込みには制限を設ける場合があります。
- ・ 当ファンドの取得のお申込みに当たっては、販売会社において投資信託説明書(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、必ずお受取りになり、記載事項をご確認のうえ、投資の最終決定はご自身でご判断ください。



ALLIANCEBERNSTEIN®

アライアンス・バーンスタイン株式会社

〒100-0011

東京都千代田区内幸町二丁目1番6号

日比谷パークフロント14階

TEL: 03-5962-9000(代)

www.alliancebernstein.co.jp

お客様にご負担いただく費用

■投資者が直接的に負担する費用

【購入時手数料】

購入価額と購入口数を乗じて得た金額に、販売会社が別に定める購入時手数料率(3.3%(税抜3.0%)を上限とします。)を乗じて得た額とします。

購入時手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供等、ならびに購入に関する事務手続きの対価として購入時にお支払いいただく費用です。

【信託財産留保額】

換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額とします。

■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)

ファンド 純資産総額に対して年率 1.0197%(税抜 0.927%)

投資対象ファンド 年率 0.81%(上限)

実質的な負担 純資産総額に対して年率 1.8297%(税抜 1.737%)(上限)

その他の費用・手数料

●金融商品等の売買委託手数料／外貨建資産の保管等に要する費用／信託財産に関する租税／信託事務の処理に要する諸費用等

※ 投資者の皆様が保有期間中その都度かかります。なお、これらの費用は運用状況等により変動するため、事前に料率・上限額等を表示できません。

●監査費用／法定書類関係費用／計理業務関係費用／受益権の管理事務に係る費用等

※ 純資産総額に対して年 0.1%(税込)の率を上限として、信託財産より間接的にご負担いただく場合があります(これらに該当する業務を委託する場合は、その委託費用を含みます。)。かかる諸費用は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産中から委託会社に対して支払われます。

※ ファンドの費用の合計額については、投資者の皆様が当ファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

以上