

2026年2月26日

三菱UFJ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404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

米ドル建てのCLOに投資を行うファンドの設定および運用開始について

三菱UFJアセットマネジメント株式会社（東京都港区、取締役社長 横川 直、以下「三菱UFJアセットマネジメント」）は、2024年9月9日付「資産運用ビジネスに係るグループ内での投資機能の移転」※1で公表しました通り、株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（代表取締役社長 亀澤 宏規）、三菱UFJ信託銀行株式会社（取締役社長 窪田 博）および株式会社三菱UFJ銀行（取締役頭取執行役員 半沢 淳一）と、グループ内でクレジット領域の投資機能の移転を進めてまいりました。このたび、この取組の一環として、米ドル建てのCLO※2に投資を行う適格機関投資家向けの私募ファンド（以下、当ファンド）を新規に設定、運用を開始いたしますのでお知らせします。

1. ファンドの特徴

当ファンドは、主として取得時においてAAA格相当の格付けを取得する予定（または取得している）の米ドル建てのCLOに投資し、利子収益の確保をめざします。また、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図ります。CLOは変動金利であるため金利上昇への耐性があり、安定した利子収益を得られる可能性があるほか、他の高格付けの先進国債券と比較して相対的に高い利回りを期待することができます。

海外の変動金利資産に投資する当ファンドは、固定金利資産に投資するファンドと並ぶ、債券投資の新たな選択肢として投資家の皆さまの資産運用に貢献できるものと考えています。

2. 今後の取組

三菱UFJアセットマネジメントは、当ファンドの運用に加え、既にCLOで開始している投資助言の対象拡大や投資一任への機能拡張なども引き続き検討を進め、お客さまにさらに多様な商品・サービスを提供することで、今後とも資産運用立国の実現に貢献してまいります。

※1 2024年9月9日付の「資産運用ビジネスに係るグループ内での投資機能の移転について」は、以下リンクをご参照ください。

https://www.am.mufg.jp/corp/press/_icsFiles/afieldfile/2024/09/09/release_240909.pdf

※2 Collateralized Loan Obligation の略で、一般的に担保が付いた信用度が比較的低い非投資適格企業向けローンを裏付資産とした、優先劣後構造を持つ証券化商品の一種です。

【当資料のご利用にあたっての注意事項等】

- 当資料は、プレスリリースとして三菱UFJアセットマネジメントが作成したものであり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。
- 当ファンドは適格機関投資家私募であり、一般投資家の方は、直接、当ファンドへの投資を行うことはできません。
- 当資料の内容は作成時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。
- 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・完全性等を保証するものではありません。

以上