

2025年12月5日

コールオプションを機動的に活用するファンドが登場！  
ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド(毎月決算・予想分配金提示型)  
ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド<為替リスク限定型>(毎月決算・予想分配金提示型)  
の設定について

ニッセイアセットマネジメント株式会社(社長：大関 洋)は、追加型の株式投資信託「ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド(毎月決算・予想分配金提示型)」、「ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド<為替リスク限定型>(毎月決算・予想分配金提示型)」の設定・運用開始を2026年1月30日に予定しています。

当ファンドは、投資対象とする外国投資信託証券を通じて、実質的にS&P500指数を原資産とする先物取引とオプション取引を行います。加えてニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド(毎月決算・予想分配金提示型)では、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受をめざします。

商 品 名：ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド(毎月決算・予想分配金提示型)  
ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド  
<為替リスク限定型>(毎月決算・予想分配金提示型)

商 品 分 類：追加型投信／海外／株式

当初申込期間：2025年12月22日～2026年1月29日

継続申込期間：2026年1月30日以降

設 定 日：2026年1月30日

取扱販売会社：あかつき証券株式会社、大熊本証券株式会社

### ■ファンドの特色

#### ① 外国投資信託証券への投資を通じて、実質的に米国株式に投資します。

- ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド(毎月決算・予想分配金提示型)は、「レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ(ケイマン)トラストーUSエクイティ・プラス・ロング・コール・ストラテジーファンド(クラスA)」(以下「外国投資信託証券」ということがあります)および「ニッセイマネーマーケットマザーファンド」を投資対象とするファンド・オブ・ファンズ※方式で運用を行います。
- ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド<為替リスク限定型>(毎月決算・予想分配金提示型)は、「レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ(ケイマン)トラストーUSエクイティ・プラス・ロング・コール・ストラテジーファンド(クラスB)」(以下「外国投資信託証券」ということがあります)および「ニッセイマネーマーケットマザーファンド」を投資対象とするファンド・オブ・ファンズ※方式で運用を行います。
- 外国投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- 外国投資信託証券の運用は、シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッドが行います。

※ファンド・オブ・ファンズとは、投資対象を投資信託証券とするファンドです。

#### シティグループのご紹介

シティグループは、国際取引を必要とするお客様のための卓越した金融パートナー、ウェルス・マネジメント分野のグローバルリーダーであり、米国市場で高く評価されているパーソナル・バンキング事業を展開している金融機関です。世界約160の国と地域において、個人、法人、政府機関などのお客様に幅広い金融商品とサービスを提供しています。100年以上前に日本に参入し、以来、政府機関、金融機関、事業法人、機関投資家など、日本のお客様のあらゆるファイナンスのニーズにお応えしています。



ひたむきにその先を見つめ、より良い未来へつなぐ  
— A Good Investment for the Future —

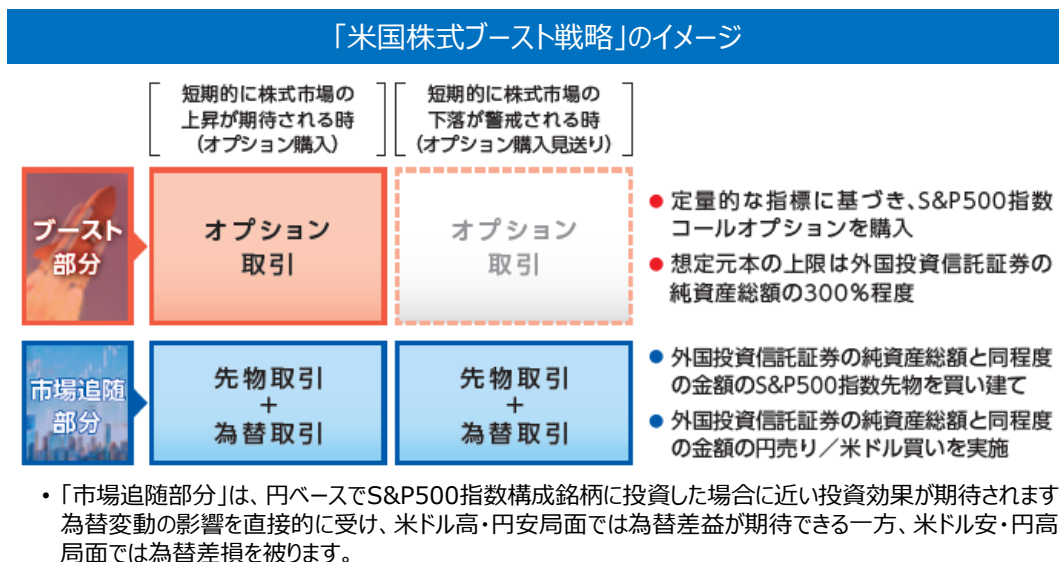


② 為替取引を活用するファンドと為替リスクを限定したファンドの2種類から選択いただけます。

**[ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド(毎月決算・予想分配金提示型)]**

先物取引・為替取引とオプション取引を活用する「米国株式ブースト戦略」により、積極的にリターンを追求します。

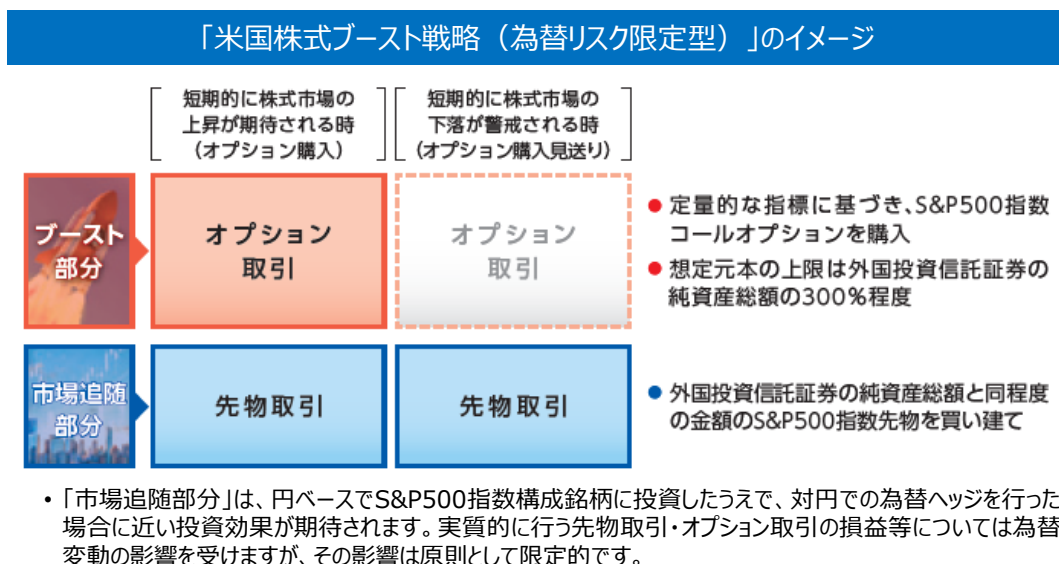
- 投資対象とする外国投資信託証券で行う「米国株式ブースト戦略」は、先物取引と為替取引を行う「市場追随部分」とオプション取引を行う「ブースト部分」で構成されます。実質的に、S&P500指数を原資産とする先物を買って、翌営業日を満期とするコールオプションを購入するとともに、円売り／米ドル買いを実施します。
- 「ブースト部分」で行うオプション取引については、定量的な指標に基づき、購入日と購入量を決定します。



**[ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド<為替リスク限定型> (毎月決算・予想分配金提示型)]**

先物取引とオプション取引を活用する「米国株式ブースト戦略（為替リスク限定型）」により、積極的にリターンを追求します。

- 投資対象とする外国投資信託証券で行う「米国株式ブースト戦略（為替リスク限定型）」は、先物取引を行う「市場追随部分」とオプション取引を行う「ブースト部分」で構成されます。実質的に、S&P500指数を原資産とする先物を買って、翌営業日を満期とするコールオプションを購入します。
- 「ブースト部分」で行うオプション取引については、定量的な指標に基づき、購入日と購入量を決定します。



※上記の記載内容は、今後変更となる場合があります。

## S&P500指数について

S&P500指数®とは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等の上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。

### ● シティグループの免責事項

シティUSエクイティ・プラス・ロング・コール指数およびシティUSエクイティ・プラス・ロング・コール2指数（以下、本インデックス）は、本インデックスの管理者および計算代理人としてのシティグループ・グローバル・マーケット・リミテッドにより提供されます。

シティグループ・グローバル・マーケット・リミテッドおよびその関連会社（以下総称して「シティグループ」といいます）は、a) ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド（毎月決算・予想分配金提示型）およびニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド＜為替リスク限定型＞（毎月決算・予想分配金提示型）（以下、本ファンド）に対して投資することへの当否、b) 本ファンドの運用成果、c) 本インデックスの水準、d) 本ファンドまたは本インデックスの商品性または特定の目的への適合性、e) その他の事項に関して、明示的にも黙示的にも、何らの表明も保証も行っておりません。シティグループは、本ファンドの支援、承認、運用、販売または促進を行っておらず、また、本ファンドに対する責任を一切負っていません。

本インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・リミテッドが所有する機密の情報です。シティグループは、その業務の通常の過程において、本インデックスの構成銘柄に関連した取引を行い、または関連を有する場合があります。これらの活動が本インデックスの水準に影響を与える可能性もあります。シティグループは発生し得る利益相反を管理するための一定の統制および緩和策を導入していますが、ある者が複数の資格において行為する場合には利益相反が生じる可能性は否定できず、かかる利益相反が本インデックスの水準に（プラスまたはマイナスの）影響を与えることがあります。シティグループは、たとえ損害の可能性が通知されたとしても、如何なる者に対しても、直接的、間接的、特別の、懲罰的、派生的、その他の責任を何ら負わないものとします。シティグループ・グローバル・マーケット・リミテッドは、(a) 本インデックスの算定、公表または通知を継続すべき義務を負うものではなく、(b) シティグループ・グローバル・マーケット・リミテッドに詐欺、過失、故意の不履行、義務（制定法上の義務を含みます）の違反または悪意がない場合には、本インデックスに関する誤り、脱落、中断または遅延に関して責任を負わず、また、(c) 他の者の代理人または受託者としてではなく、本人として行動するものとします。

シティは、世界中で使用・登録されているシティグループ・インクまたはその関連会社の登録商標およびサービスマークです。

### ③ 毎月決算を行い、決算日の前営業日の基準価額に応じた分配をめざします。

- 毎月10日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。
- 収益分配方針に基づき、決算日の前営業日の基準価額（1万口当り。支払い済みの分配金累計額は加算しません）に応じて、以下の金額の分配を行うことをめざします。

| 決算日の前営業日の基準価額      | 分配金額(1万口当り、税引前) |
|--------------------|-----------------|
| 11,000円未満          | 基準価額の水準等を勘案して決定 |
| 11,000円以上12,000円未満 | 200円            |
| 12,000円以上13,000円未満 | 300円            |
| 13,000円以上14,000円未満 | 400円            |
| 14,000円以上          | 500円            |

- ・ 決算日の前営業日から決算日までに基準価額が急激に変動した場合等には、上記とは異なる分配金額となる場合や分配金が支払われない場合があります。
- ・ 基準価額の値上がりにより、該当する分配金テーブルが分配金の支払い準備のために用意していた資金を超える場合等には、テーブル通りの分配ができないことがあります。
- ・ 基準価額に応じて、毎月の分配金額は変動します。基準価額があらかじめ決められた水準に一度でも到達すれば、その水準に応じた分配を継続するというものではありません。
- ・ 分配を行うことにより基準価額は下落します。そのため、基準価額に影響を与え、次期決算以降の分配金額は変動する場合があります。また、あらかじめ一定の分配金額を保証するものではありません。

**❗ 将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。**

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ■お申込みメモ

|             |   |
|-------------|---|
| 購入価額        | ①当初申込期間：1口当たり1円とします。<br>②継続申込期間：購入申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。   |
| 換金価額        | 換金申込受付日の翌々営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた額とします。  |
| 換金代金        | 換金申込受付日から起算して、原則として8営業日目からお支払いします。  |
| 申込締切時間      | 原則として毎営業日の午後3時30分までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。<br>ただし、申込締切時間は販売会社によって異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にご確認ください。   |
| 申込不可日       | 申込日、その翌営業日または翌々営業日がニューヨーク証券取引所（半休日を含みます）、ニューヨークの銀行、シカゴ・オプション取引所（半休日を含みます）、ロンドンの銀行のいずれかの休業日と同日の場合は、購入・換金の申込みの受け付けを行いません。<br>また、換金の申込みにおいて、換金代金のお支払い等に支障をきたすおそれがあるとして委託会社が定める日は、申込みの受け付けを行いません。 |
| 購入の<br>申込期間 | ①当初申込期間：2025年12月22日～2026年1月29日<br>②継続申込期間：2026年1月30日以降  |
| 信託期間        | 2036年1月10日まで（設定日：2026年1月30日）  |
| 繰上償還        | 委託会社はあらかじめ受益者に書面により通知する等の手続きを経て、ファンドを繰上償還させることがあります。  |
| 決算日         | 毎月10日（該当日が休業日の場合は翌営業日）  |
| 課税関係        | 課税上は株式投資信託として取扱われます。公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の対象となりますが、当ファンドは、NISAの対象ではありません。   |



## ■ファンドの費用

| 投資者が直接的に負担する費用      |                        |   |  |
|---------------------|------------------------|---|--|
| 購入時                 | 購入時手数料                 | 購入申込受付日の翌々営業日の基準価額(当初申込期間：1口当り1円)に <b>3.3%(税抜3.0%)を上限</b> として販売会社が独自に定める率をかけた額とします。<br>●料率は変更となる場合があります。詳しくは販売会社にお問合せください。  |  |
| 換金時                 | 信託財産留保額                | 換金申込受付日の翌々営業日の基準価額に <b>0.12%</b> をかけた額とします。   |  |
| 投資者が信託財産で間接的に負担する費用 |                        |   |  |
| 毎 日                 | 運用管理費用<br>(信託報酬)       | ファンドの純資産総額に年率1.3475%(税抜1.225%)をかけた額とし、ファンドからご負担いただきます。  |  |
|                     |                        | 投資対象とする<br>外国投資信託<br>証券   | 年率0.2%程度<br>・年間最低報酬額等がかかる場合、純資産総額等によっては年率換算で上記の料率を上回ることがあります。  |
|                     |                        | 実質的な負担  | ファンドの純資産総額に <b>年率1.5475%(税込)程度</b> をかけた額となります。<br>●上記は目安であり、各指定投資信託証券への投資比率が変動することにより、投資者が負担する実質的な運用管理費用（信託報酬）は変動します。また、投資対象とする外国投資信託証券に年間最低報酬額等がかかる場合、その純資産総額等によっては年率換算で上記の料率を上回ることがあります。 |
|                     | 監 査 費 用                | ファンドの純資産総額に年率0.011%(税抜0.01%)をかけた額を上限とし、ファンドからご負担いただきます。   |  |
| 随 時                 | そ の 他 の<br>費 用 ・ 手 数 料 | ●ファンドが投資対象とする外国投資信託証券では、シティグループ・グローバル・マーケット・リミテッドとの担保付スワップ契約に基づき、先物取引・為替取引およびオプション取引（為替取引はニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド（毎月決算・予想分配金提示型）のみ）のパフォーマンス（指数値）を日次で受取ります。当該指数値の算出にあたっては、指数の評価額に対して年率0.3%の算出費用が日次で発生します。また、当該証券の一部解約に際しては、解約により終了するスワップ取引の想定元本額に対して0.12%の取引費用が発生します。なお、当該取引費用にかかる投資者の実質的な負担は、前記「投資者が直接的に負担する費用」に記載の信託財産留保額に相当します。<br><br>●有価証券の売買委託手数料、信託事務の諸費用および借入金の利息等はファンドからご負担いただきます。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・上限額等を記載することはできません。 |  |

**!** 当該費用の合計額、その上限額および計算方法は、運用状況および受益者の保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

## ■投資リスク

- 当ファンドは、円建ての外国投資信託証券を通じてデリバティブ取引を活用し、実質的にS&P500指数を原資産とする株価指数先物取引とオプション取引を行います。加えてニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド(毎月決算・予想分配金提示型)は、円売り／米ドル買いの為替取引により米ドルへの投資効果の享受をめざします。株価指数先物取引では当該先物を買って建て、先物価格はS&P500指数の値動きなどの影響を受け変動するため、価格が下落することがあります。オプション取引ではコールオプションを購入するため、S&P500指数が、オプションの行使価格にオプションの購入時に支払ったオプション料を加えた水準を下回った場合には、オプション料相当額を上限とする損失が発生します。また、デリバティブ取引においては、取引相手先の財務状況の悪化等によりあらかじめ定められた条件で取引が履行されない場合などには、ファンドの資産価値が減少する要因となります。これらの要因により、ファンドの基準価額が下落し損失を被ることがあります。また、これらに加え、為替の変動により損失を被ることがあります。
- **ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果(損益)はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。**
- 当ファンドの基準価額の主な変動要因としては、「デリバティブ取引等に関するリスク」、「短期金融資産の運用に関するリスク」、「株価指数先物取引に関するリスク」、「為替変動リスク」、「カントリーリスク」、「コールオプションに関するリスク」、「定量的な指標に基づく運用に関するリスク」、「流動性リスク」などがあります。

## ■分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

## ■ご留意いただきたい事項

- 投資信託はリスクを含む商品であり、運用実績は市場環境等により変動し、運用成果(損益)はすべて投資者の皆様のもとなります。投資元本および利回りが保証された商品ではありません。
- 当資料はシティグループの情報等をもとにニッセイアセットマネジメントが作成したものです。ご購入に際しては、販売会社よりお渡しする投資信託説明書（交付目論見書）、契約締結前交付書面等（目論見書補完書面を含む）の内容を十分にお読みになり、ご自身でご判断ください。
- 投資信託は保険契約や金融機関の預金ではなく、保険契約者保護機構、預金保険の対象とはなりません。証券会社以外の金融機関で購入された投資信託は、投資者保護基金の支払対象にはなりません。
- 当資料は信頼できると考えられる情報に基づいて作成しておりますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。記載内容は資料作成時点のものであり、予告なしに変更されることがあります。
- 当資料にインデックス・統計資料等が記載される場合、それらの知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。
- S&P各種指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスに帰属します。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは同社が公表する各指数またはそれに含まれるデータの正確性あるいは完全性を保証するものではなく、また同社が公表する各指数またはそれに含まれるデータを利用した結果生じた事項に関して保証等の責任を負うものではありません。