投資信託説明書（交付目論見書）

使用開始日
2026年11月11日



当ファンドは、特化型運用を行います。

シティグループ社債／One米国株式戦略ファンド2026−12

愛称：おまもりOne・M4

単位型投信／海外／資産複合／特殊型（条件付運用型）

商品分類				属性区分				
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	為替ヘッジ※	特殊型
単位型	海外	資産複合	特殊型（条件付運用型）	債券（社債）	年2回	北米	なし	条件付運用型

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。
◆上記の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人資産運用業協会のホームページ（https://www.imaj.or.jp/）でご覧いただけます。

この目論見書により行う「シティグループ社債／One米国株式戦略ファンド2026−12」の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により、有価証券届出書を2026年11月6日に関東財務局長に提出しております。当該届出書の効力の発生の有無については、委託会社への照会先までお問い合わせください。なお、効力が生じていない場合においては、本書に記載された内容につき訂正が行われる場合があります。

■本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
■ファンドに関する金融商品取引法第15条第3項に規定する目論見書（以下、「請求目論見書」といいます。）は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
本書には約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、販売会社に請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。
■約款の内容の重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
■ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
■ファンドの販売会社、基準価額等については委託会社の照会先までお問い合わせください。

〈委託会社〉［ファンドの運用の指図を行う者］
アセットマネジメントOne株式会社
金融商品取引業者登録番号:関東財務局長（金商）第324号
設立年月日:1985年7月1日
資本金:20億円（2026年8月末現在）
運用する投資信託財産の合計純資産総額:25兆2,003億円
（2026年8月末現在）

委託会社への照会先
【コールセンター】
0120-104-694
（受付時間:営業日の午前9時～午後5時）
【ホームページアドレス】
https://www.am-one.co.jp/

〈受託会社〉［ファンドの財産の保管および管理を行う者］
みずほ信託銀行株式会社

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を図ることを目的として、運用を行います。

ファンドの特色

1 当ファンドはシティグループ・グローバル・マーケッツ・ホールディングス・インクが発行する円建債券*1（以下「シティグループ社債」といいます。）に高位に投資*2し、設定日から約5年後の満期償還時の当ファンドの償還価額*3について、元本確保をめざします*4。

*1 シティグループ・グローバル・マーケッツ・ホールディングス・インクが発行し、シティグループ・インクによる保証が付されます。

*2 満期まで保有することを前提とし、原則として銘柄入替は行いません。

*3 当ファンドは、信託期間約5年の単位型投資信託です。

*4 元本には購入時手数料は含みません。投資する債券の発行体・保証体等が債務不履行となった場合等には、元本確保ができない場合があります。信託期間中に当ファンドを解約した場合や当ファンドが繰上償還された場合等には、解約価額や償還価額が元本を下回る場合があります。

シティグループ・グローバル・マーケッツ・ホールディングス・インクについて

シティグループ・グローバル・マーケッツ・ホールディングス・インク（CGMHI）は、子会社を通じて、包括的に投資銀行業務および証券仲介業務の分野で事業を行っており、シティグループ・インクが全ての株式を所有しています。

シティグループについて

●シティグループは、国際取引を行うお客さまの卓越した金融パートナーとして、ウェルス・マネジメントや米国で評価の高いパーソナル・バンキングを展開する金融機関です。FSB（金融安定理事会）から、世界的な巨大銀行の一つとして指定されています。

●シティグループの総資産は、約470兆629億円*です。

*2026年6月末現在。1米ドル=162.39円（2026年6月末）で換算。
出所:シティグループのデータをもとに委託会社作成

●当ファンドの投資対象には、一般社団法人資産運用業協会規則の信用リスク集中回避のための投資制限に定められた比率を超える支配的な銘柄（当ファンドの場合は、特定の発行体が発行する社債）が存在するため、当ファンドは当該支配的な銘柄に集中して投資を行う特化型運用を行います。

●当ファンドは、シティグループ社債に限定して投資を行いますので、当該債券の発行体・保証体等に経営破たんや経営・財務状況の悪化などが生じた場合には、大きな損失が発生することがあります。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

ファンドの目的・特色

2 当ファンドは米国株式戦略指数 VT5.5の累積収益率により決定される実績連動クーポンと固定クーポンで構成されるシティグループ社債の利金を獲得することをめざします。

●固定クーポンは、毎期および満期時に一定水準支払われ、信託報酬等に充当することをめざします。

●実績連動クーポンの水準は、各計測期間[*5]の米国株式戦略指数 VT5.5の累積収益率に一定の連動率[*6]を乗じた水準に決定され、シティグループ社債の発行から約2.5年後の利払時（以下「約2.5年後利払時」といいます。）、および満期時に支払われます。

●米国株式戦略指数 VT5.5は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・リミテッドが指数スポンサーを務める指数で、米国株価指数（S&P500株価指数）先物を、実質的な構成資産とし、目標リスク水準が年率5.5%程度となるように、米国株価指数先物の比率を調整します。同指数の損益は、戦略控除率（年率0.3%）、複製コスト、取引コストを控除したものになります。

※上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれも約束するものではありません。また、上記数値はリスク水準の目標を表すものであり、年率5.5%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。

*5 各計測期間は、約2.5年後利払時は2026年12月29日～2029年6月1日、満期時は2029年6月1日～2031年12月1日の予定（海外の休日等により変更される可能性があります。）です。

*6 連動率※は、ファンド設定時の市場環境等によって決定されます。

※連動率は100%程度を想定しておりますが、ファンド設定時の市場環境等によって決定されるため、これを大きく上回ることや、下回ることがあります。

3 当ファンドはシティグループ社債の利金収入から諸コスト等[*7]を差し引いた分配原資のなかから、決算時に分配金額を決定します。

●信託財産の成長に資することを考慮し、分配を抑制することを基本としますが、2029年6月期の決算時には、実績連動クーポンによる分配原資のなかから分配を行うことをめざします。

*7 信託報酬およびその他の費用等です。

※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。分配対象額が少額の場合は、分配を行わない場合があります。

※当ファンドは、満期償還時における元本確保をめざしますが、元本の確保を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、上記の運用ができない場合があります。

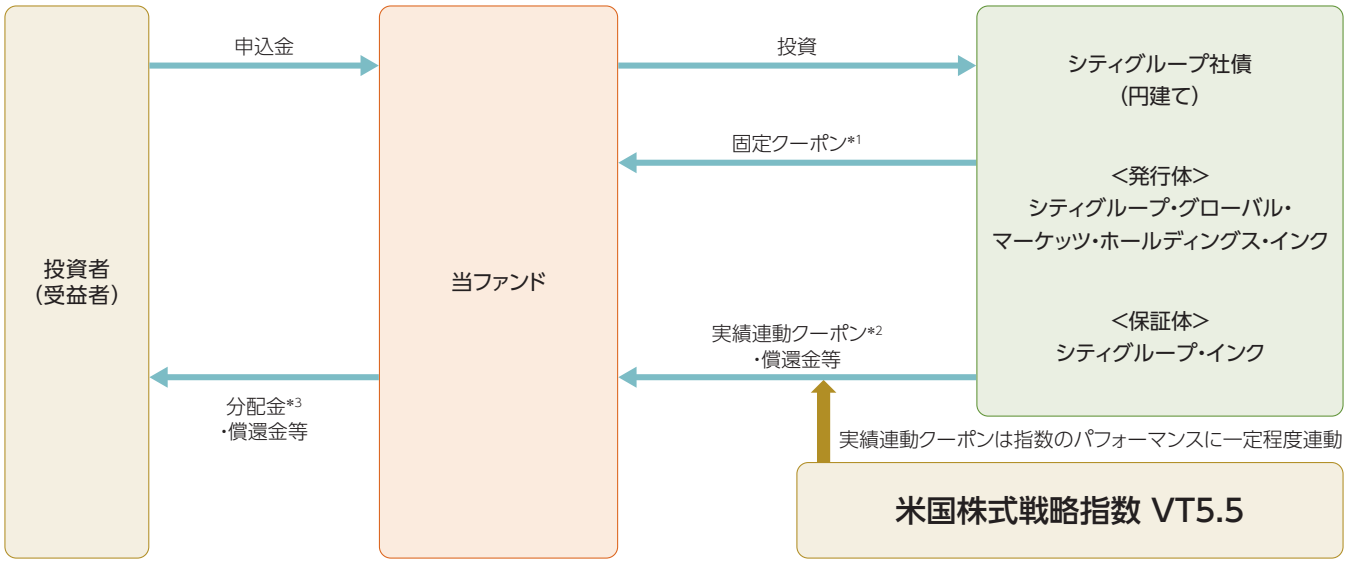
ファンドの目的・特色

運用プロセス

ファンドの設定

シティグループ社債（円建て）に投資し、原則として満期まで保有します。

ファンドの仕組み



*1 固定クーポンは、信託報酬等に充当することをめざします。満期時の固定クーポンは償還金として支払われます。

*2 実績連動クーポンは、各計測期間の米国株式戦略指数 VT5.5の累積収益率に一定の連動率を乗じて決定され、シティグループ社債の発行から約2.5年後の利払時、および満期時に支払われます。各計測期間中の米国株式戦略指数 VT5.5の累積収益率がマイナスの場合には実績連動クーポンはゼロになります。なお、満期時の実績連動クーポンは償還金に含まれて支払われます。

*3 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

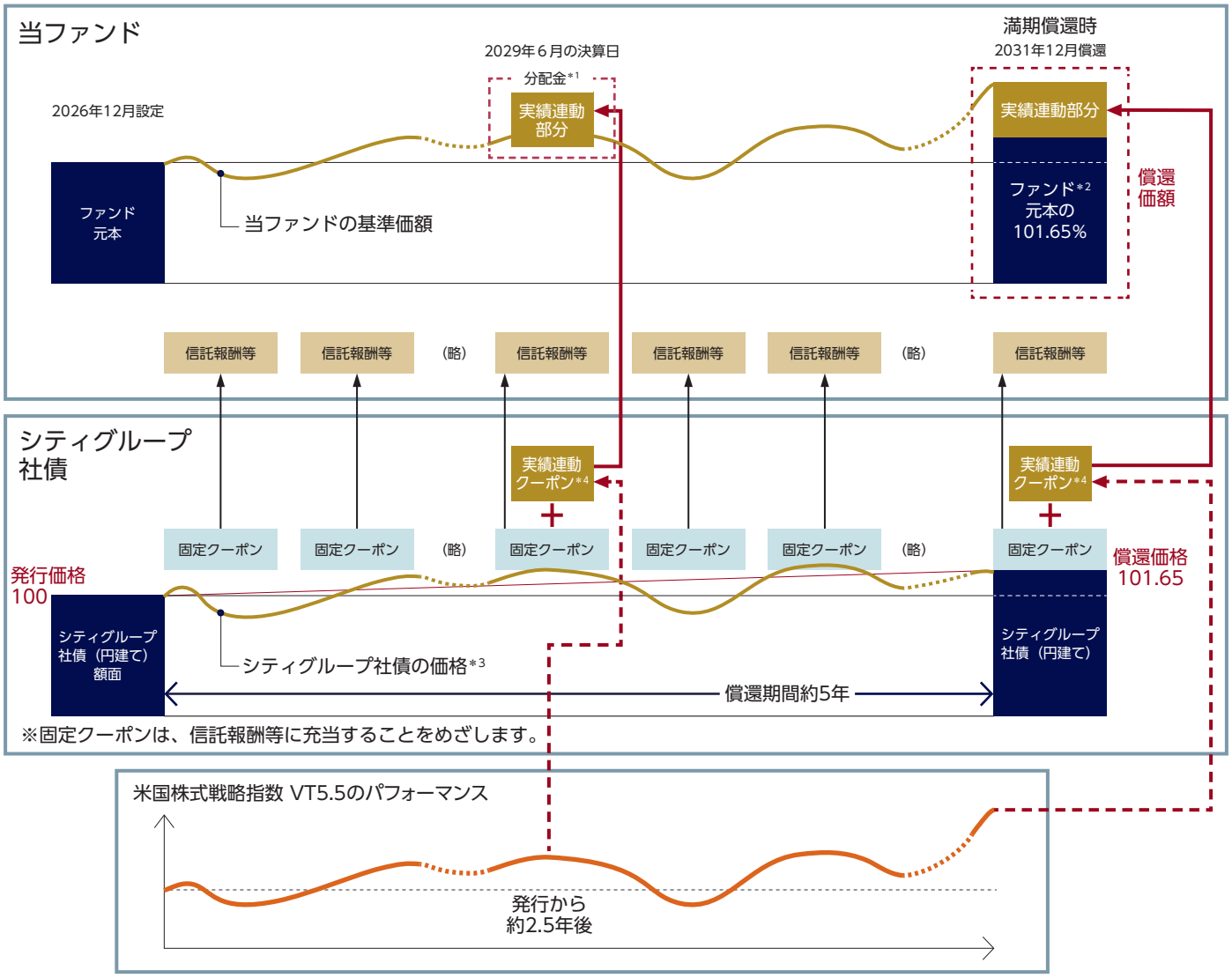
※図は、当ファンドをご理解いただくためのイメージです。

※投資する債券の発行体・保証体等が債務不履行となった場合等には、元本確保ができない場合があります。信託期間中に当ファンドを解約した場合や当ファンドが繰上償還された場合等には、解約価額や償還価額が元本を下回る場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

ファンドの目的・特色

<当ファンドとシティグループ社債の関係（イメージ）>



*1 実績連動クーポンによる分配原資のなかから分配を行うことをめざしますが、分配金額は分配方針に基づいて委託会社が決定します。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なく、分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。

*2 当ファンドは満期償還時にファンド元本の101.65%での償還をめざしますが、当該水準での償還を保証するものではありません。

*3 シティグループ社債の価格イメージはクーポンを含まない価格です。

*4 実績連動クーポンは、シティグループ社債の利金の1つを指します。約2.5年後の利払時は、計測期間（2026年12月29日～2029年6月1日（海外の休日等により変更される可能性があります。））の米国株式戦略指数 VT5.5の累積収益率に一定の連動率を乗じた水準に、満期時は、計測期間（2029年6月1日～2031年12月1日（海外の休日等により変更される可能性があります。））の米国株式戦略指数 VT5.5の累積収益率に一定の連動率を乗じた水準に決定されます。米国株式戦略指数 VT5.5の累積収益率がマイナスの場合は、実績連動クーポンはゼロになります。

※上記はイメージであり、すべてを表すものではありません。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

ファンドの目的・特色

◆ 実績連動クーポンについて

米国株式のパフォーマンスに連動する収益は、実績連動クーポンを通じて獲得されます。
実績連動クーポンは、米国株式戦略指数 VT5.5の累積収益率に基づき決定され、シティグループ社債の発行から約2.5年後の利払時、および満期時に支払われます。

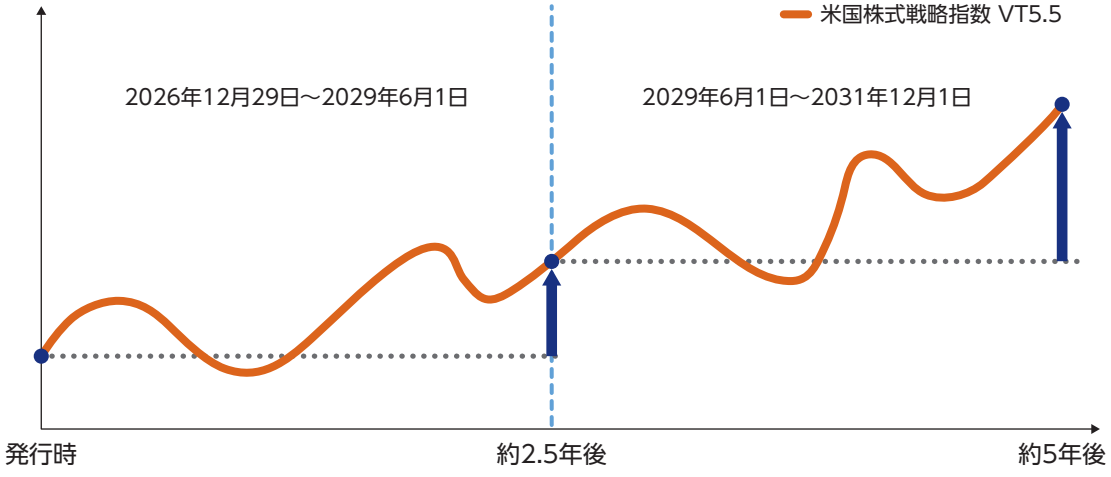
実績連動クーポンの算出式

実績連動クーポン ＝ 指数の累積収益率 × 連動率*

*連動率は、どれだけ指数と同調した動きをするかを示す数値です。連動率は、100%程度を想定しておりますが、ファンド設定時の市場環境等によって決定されるため、これを大きく上回ることや、下回ることがあります。

実績連動クーポンの算出に用いる累積収益率のイメージ

累積収益率は、以下期間*ごとに計測されます。



*累積収益率の計測に用いる期間は海外の休日等により変更される可能性があります。

※約2.5年後の利払時および満期時に指数の累積収益率がマイナスの場合は、実績連動クーポンがゼロとなりますが、当ファンドの償還価額にマイナスの影響を与えることはありません。

※上記は実績連動クーポンの算出方法をご理解いただくためのイメージであり、当ファンドの分配金を説明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、上記の運用ができない場合があります。

ファンドの目的・特色

主な投資制限

•株式への投資割合には、制限を設けません。
•外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
•投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
•デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
•1発行体等当たりの株式等、債券等およびデリバティブ等の信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とします。ただし、シティグループ・グローバル・マーケッツ・ホールディングス・インクが発行する円建債券の投資割合には、制限を設けません。

分配方針

年2回の決算時（毎年6月および12月の各25日（休業日の場合は翌営業日））に、元本超過額または経費控除後の配当等収益のいずれか多い額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

※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。
※分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
*初回決算日は2027年6月25日です。

シティグループの免責条項
米国株式戦略指数 VT5.5は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・リミテッド（その関連会社を含めて、以下「シティグループ」といいます。）によって管理および公表されています。
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。「シティグループ社債／One米国株式戦略ファンド2026−12」（以下「本商品」といいます。）は、シティグループによって設計、支援、承認、販売、引受、促進、発行または管理されておらず、またシティグループは、本商品に対して投資することの推奨性について、一切の表明を行っていません。シティグループは、商品性および特定の目的または使用に関する適合性の保証を含む（ただし、これらに限られない。）一切の明示または黙示の保証を行っていません。いかなる場合であっても、シティグループは、シティグループのデータおよび情報の使用に関連して、直接損害、間接損害、特別損害または派生的損害に対して、一切責任を負いません。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

投資リスク

基準価額の変動要因

当ファンドは、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
また、投資信託は預貯金と異なります。

価格変動リスク

市場金利の変化、債券の発行体・保証体の信用状況やその資金調達を行う市場環境の悪化、米国株式戦略指数 VT5.5の収益率の低下は、当ファンドが投資する円建債券の価格、ひいては基準価額の下落要因となります。

<債券>
金利の変動は、公社債等の価格に影響をおよぼします。金利の上昇は、一般に公社債の価格を下落させ、基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドが投資する債券は、米国株式戦略指数 VT5.5の累積収益率に基づき発行から約2.5年後の利払時、および満期時のクーポン総額が変動します。当該収益率がマイナスとなった場合は実績連動クーポンがゼロとなり、債券の利金は固定クーポンのみとなります。市場金利や債券の発行体・保証体等の信用状況に変化がない場合でも、債券の発行体・保証体等が資金調達を行う市場環境が悪化した場合や米国株式戦略指数 VT5.5の収益率が低下することにより発行から約2.5年後の利払時、および満期時のクーポン総額が低下すると見込まれる場合は、債券価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。

<米国株式戦略指数 VT5.5>
当ファンドの実績連動クーポンの算出の基準となる米国株式戦略指数 VT5.5の収益率の主な変動要因は、以下のとおりです。

・米国株式戦略指数 VT5.5は米国株価指数先物により構成され、所定の目標リスク水準となるように比率を調整します。株価指数（株価指数を構成する銘柄の価格）が下落した場合、株価指数の値動きが期待したものと異なった場合等には、指数の収益率が下落する要因となります。
・米国株式戦略指数 VT5.5については、米国株価指数先物をもとに算出されるため、当該取引の評価損益は為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該評価損益の通貨に対して円高になった場合には、指数の収益率が下落する可能性があります。

信　用リスク

投資する債券の発行体または保証体の経営不安・倒産等の発生は、基準価額が著しく下落する要因となります。

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。
当ファンドが投資するシティグループ・グローバル・マーケッツ・ホールディングス・インク発行の円建債券はシティグループ・インクが保証を行います。
投資する債券の発行体・保証体等の信用力が業績悪化・経営不振などにより著しく低下した場合、あるいは倒産した場合、その影響を大きく受け、基準価額が著しく下落する可能性があります。

投資リスク

銘柄集中リスク

特定の債券への集中投資は当該債券へのリスクが顕在化した場合、基準価額が著しく下落する要因となります。

ファンドは特定の債券（単一銘柄）を組み入れ、原則として銘柄入替を行わない方針です。当該債券へのリスクが顕在化した場合、多数の銘柄に分散投資を行う投資信託の場合と比較し、大きな影響を被り、基準価額が著しく下落する要因となります。

流動性リスク

市場混乱や投資する債券の発行体等の信用状況の著しい悪化等により流動性が著しく低下し、売却価格が想定される価格と乖離した場合は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドが投資する債券は、市場混乱等があった場合、債券の発行体・保証体等の信用状況が著しく悪化した場合等には流動性が著しく低下し、売却価格が一般的に想定される価格と乖離することにより、想定以上にファンドの基準価額が下落し、損失を被る可能性があります。また、債券の発行体・保証体等の信用リスクが顕在化した場合等には、当該債券の一部売却ができなくなり、そのために換金の受付を中止することがあります。

早期償還リスク

投資する債券が債務不履行・早期償還等となった場合は、時価で換金されるため、ファンドの償還価額も投資元本を下回る可能性があります。

当ファンドは、満期償還時点において受益者の投資元本の確保をめざしますが、主要投資対象とする債券が以下に掲げる場合等により債務不履行（デフォルト）となった場合、または法令・税制の変更もしくは指数スポンサーの判断等により早期償還となる場合、当該債券の資金化後に繰上償還を行います。その場合、当該債券は時価で換金されるため元本の確保ができず、ファンドの償還価額も投資元本を下回る可能性があります。

<投資対象とする債券が債務不履行（デフォルト）となる主な場合>

1. 本債券について支払期限が到来した元利金の支払いについて債務不履行（デフォルト）が発生し、かかる不履行が30日間継続すること。
2. 発行体が本債券に基づく、またはこれに関するその他の義務を履行せず、かかる不履行の治癒を求める発行体宛ての通知がなされた後60日間かかる不履行が継続すること。
3. 米国の連邦または州の破産法、支払不能法その他類似の法律に基づき、任意手続きを発行体が開始すること、または非任意手続きにおける発行体の救済もしくは発行体の実質的全財産に係る管財人の選任等の決定に発行体が同意しもしくはかかる決定が90日間継続すること等。

※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。

＊基準価額の推移（イメージ）



当ファンドは、シティグループ社債に集中して投資を行いますので、基準価額は当該債券の価格変動の影響を受けます。

シティグループ社債の債券価格の主な下落要因は次のとおりです。
①国内金利の上昇
②発行体等の信用リスクの悪化に伴う信用スプレッドの拡大
③米国株式戦略指数 VT5.5のパフォーマンス下落

※上記はイメージであり、当ファンドの基準価額の推移を示したものではありません。
※当ファンドは満期償還時にファンド元本の101.65%での償還をめざしますが、当該水準での償還を保証するものではありません。

投資リスク

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、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生じた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およぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- 収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。
  - •収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、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。
  - •分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、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。
- 米国株式戦略指数 VT5.5に重大な変更があった場合、または算出・公表が停止等された場合等には、主要投資対象とする債券の発行要項により、利金の条件等が変更となります。
- 税率の引き上げ、課税状況の変化、管理諸費用の増加等当初想定しえなかった費用または支出が発生した場合には、収益分配金またはファンドの償還価額が減少し、さらには投資元本を下回る水準となる可能性があります。
- 当ファンドは、中途解約した場合、換金価額が投資元本を下回る可能性があります。
- 当ファンドは、保有期間中に基準価額が1万円を下回る場合があります。

リスクの管理体制

委託会社では、運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。また、同部署がファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。

なお、委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

※リスク管理体制は、今後変更になることがあります。

投資リスク

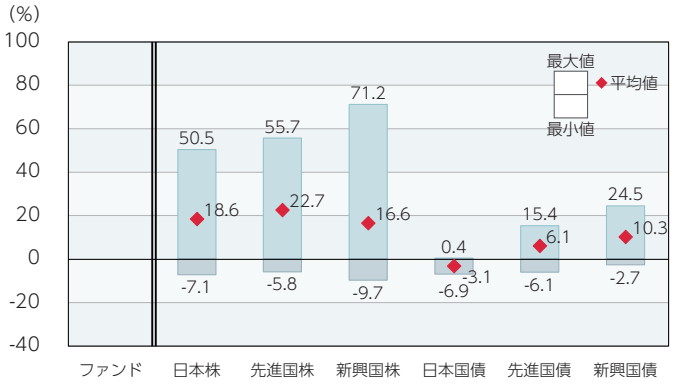
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

該当事項はありません。

*有価証券届出書提出日現在、分配金再投資基準価額およびファンドの年間騰落率はありません。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:有価証券届出書提出日現在、運用実績はありません。
代表的な資産クラス:2021年9月～2026年8月

*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

運用実績

有価証券届出書提出日現在、当ファンドの運用実績はありません。

基準価額・純資産の推移

該当事項はありません。

分配の推移

該当事項はありません。

主要な資産の状況

該当事項はありません。

年間収益率の推移

該当事項はありません。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況を開示することを予定しています。

手続・手数料等

お申込みメモ

購入単位	1口以上1口単位または1円以上1円単位で販売会社が定める単位（当初元本1口=1円）
購入価額	1口当たり1円（基準価額は1万口当たりで表示しています。）
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払いください。
換金単位	1口以上1口単位で販売会社が定める単位
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して6営業日目からお支払いします。
申込締切時間	換金のお申込みは、原則として営業日の午後3時30分までに販売会社が受付けたものを当日分のお申込みとします。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
購入の申込期間	2026年11月24日から2026年12月24日まで
換金申込不可日	以下のいずれかに該当する日には、換金のお申込みの受付を行いません。 •ロンドンの銀行、ニューヨークの銀行、ニューヨーク証券取引所、シカゴ・マーカンタイル取引所のいずれかの休業日（半休日を含みます。） •12月24日 •換金申込日から起算して2営業日目から4営業日目までのいずれかの日がロンドンの銀行の休業日の場合 •換金申込日から起算して4営業日目がユーロクリアの休業日の場合 •設定日から起算して5営業日間
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求に制限を設ける場合があります。
換金申込受付の中止および取消し	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、組み入れた円建債券の換金ができなくなった場合、その他やむを得ない事情があるときは、換金のお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた換金のお申込みの受付を取り消す場合があります。
信託期間	2031年12月23日まで（2026年12月25日設定）
繰上償還	当ファンドが主要投資対象とする債券の発行体・保証体等が債務不履行（デフォルト）となった場合、または債券が法令・税制の変更もしくは指数スポンサーの判断等により早期償還となる場合には、資金化後に信託契約を解約し、当該信託を終了（繰上償還）させます。 当ファンドが次のいずれかに該当する場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了（繰上償還）することがあります。 •信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合 •受益権口数が10億口を下回ることとなった場合 •米国株式戦略指数 VT5.5に重大な変更があった場合、または算出・公表が停止等された場合 •やむを得ない事情が発生した場合
決算日	毎年6月および12月の各25日（休業日の場合は翌営業日） ※初回決算日:2027年6月25日
収益分配	年2回の毎決算日に、収益分配方針に基づいて収益分配を行います。
信託金の限度額	1,000億円
公告	原則として、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページ（https://www.am-one.co.jp/）に掲載します。
運用報告書	ファンドの決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて交付します。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 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少額投資非課税制度（NISA）の適用対象となります。 当ファンドは、NISAの対象ではありません。 配当控除および益金不算入制度の適用はありません。
その他	購入の申込期間中において、資金動向、投資対象市場環境等によっては、購入のお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた購入のお申込みの受付を取り消し、当ファンドの設定を見送ることがあります。

手続・手数料等

ファンドの費用・税金

■ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	購入価額に、**1.65%（税抜1.5%）**を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額となります。 購入時手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。
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を、換金時にご負担いただきます。

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）

ファンドの日々の元本総額に対して、**年率0.693%（税抜0.63%）以内**[*1]

信託報酬＝運用期間中の元本×信託報酬率

※運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末、途中換金時または信託終了のときファンドから支払われます。

＊1 2026年12月25日現在は、**年率0.693%（税抜0.63%）**になります。配分は以下の通りです。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.30%以内[*2]	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.30%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

＊2 2026年12月25日現在は、年率0.33%（税抜0.30%）になります。

戦略指数に関する費用等

ファンドの主要投資対象である円建債券の実績連動クーポンは、米国株式戦略指数 VT5.5の収益率等を参照して決定されます。同指数のリターン（損益）は、米国株価指数先物の構成比率から収益率を算出し、下記の複製コスト、取引コストおよび戦略控除率等を控除して算出されます。

●複製コスト[*1]：日々の先物ポジション量に対して年率最大0.2%

●取引コスト[*1]：先物のポジションの調整量に対して都度0.01%～0.02%

＊1 複製コスト、取引コストは運用状況等により変動するため、あらかじめ合計額、上限額等を表示することができません。

●戦略控除率[*2]：年率0.3%

＊2 戦略指数に乗じる連動率等を実現するために必要なものとして、戦略指数の計算ルールにおいて定めるものです。円建債券の発行体やファンドの関係法人（委託会社や販売会社等）が報酬として受け取るものではありません。

その他の費用・手数料

その他の費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

- 組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料
- 信託事務の処理に要する諸費用
- 外国での資産の保管等に要する費用
- 監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用　　等

監査費用は毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき、その他の費用等はその都度ファンドから支払われます。

※ファンドが主要投資対象とする円建債券の発行に当たっては一定の費用等が発生しますが、債券の発行時における発行額、市況動向等により変動しますのであらかじめ料率、上限額等を示すことができません。

※これらの費用等は、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

※上記手数料等の合計額、その上限額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することができません。

手続・手数料等

■税金

●税金は表に記載の時期に適用されます。

●以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分　配　時	所得税および地方税	配当所得として課税 収益分配金に対して20.315%
換金（解約）時 および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して20.315%

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人の場合は上記とは異なります。

※上記は2026年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

（参考情報）ファンドの総経費率

ファンドは運用を開始していないため、開示できる情報はありません。（有価証券届出書提出日現在）


Asset
Management
One