

Citigroup Bond/
One US Equity and
Gold Strategy Fund

シティグループ社債／ One 米国株式・金戦略ファンド2026－06

愛称：おまもりOne・M3

単位型投信／海外／資産複合／特殊型(条件付運用型)

※当ファンドの購入申込期間は終了しています。

※課税上は株式投資信託として取り扱われます。
※当ファンドは、特化型運用を行います。

当ファンドは2026年6月26日に約100.5億円で設定し運用を開始いたしました。当資料では、投資対象であるシティグループ社債*1の発行条件の概要についてご説明いたします。

*1 シティグループ・グローバル・マーケット・ホールディングス・インク(シティグループということがあります。)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。

シティグループ社債の概要

発行日	2026年7月1日	固定クーポン	0.75%
償還日	2031年6月16日	約2.5年後の利払時の連動率*2	160%
償還期間	約5年		

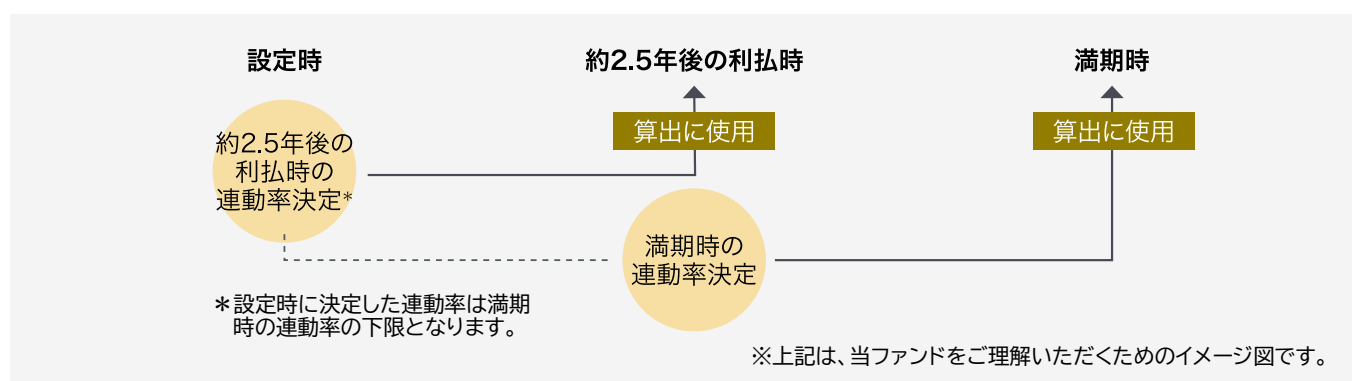
*2 連動率は実績連動クーポンを算出するための数値です。実績連動クーポンはそれぞれ約2.5年後の利払時には「米国株式・金戦略指数 VT3の累積収益率*3×設定時に決定した連動率×1/2」、満期時には「米国株式・金戦略指数 VT3の累積収益率*4×約2.5年後の利払時に決定した連動率」の計算式にて算出されます。設定時に決定した連動率は満期時の連動率の下限となります。米国株式・金戦略指数 VT3についての説明は目論見書をご覧ください。

*3 累積収益率の計測期間は2026年6月29日～2028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。)です。

*4 累積収益率の計測期間は2028年12月1日～2031年6月2日(海外の休日等により変更される可能性があります。)です。

出所：シティグループのデータをもとにアセットマネジメントOne作成

(ご参考)連動率のイメージ



- 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。
※上記は過去の情報であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

※最終ページの「ご注意事項等」をご確認ください。

ファンドの投資リスク①

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。

基準価額の変動要因

価格変動リスク	<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・金戦略指数 VT3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・金戦略指数 VT3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・金戦略指数 VT3> 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・金戦略指数 VT3の収益率の主な変動要因は、以下のとおりです。 ●米国株式・金戦略指数 VT3は米国株価指数先物および金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)および金先物価格が下落した場合、株価指数および金先物価格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・金戦略指数 VT3については、米国株価指数先物および金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	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・マーケット・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。
銘柄集中リスク	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	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。

ファンドの投資リスク②

基準価額の変動要因

早期償還リスク	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を開始すること、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。

【収益分配金に関する留意事項】

- 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。

【その他の留意点】

- 米国株式・金戦略指数 VT3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。
- 当ファンドには、大口の換金請求に関する制限、換金申込不可日等の換金に係る制限やお客さまの不利益となる事項があります。詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)の該当箇所をご覧ください。

米国株式・金戦略指数 VT3は、シティグループ・グローバル・マーケット・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・金戦略ファンド2026-06」(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。

お客さまにご負担いただく手数料等について

詳細については、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

ご換金時	換金時手数料	ありません。
	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。
保有期間中 (信託財産から 間接的にご負担 いただきます。)	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* * 2026年6月26日現在は、 年率0.693%(税抜0.63%) 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・金戦略指数 VT 3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、各先物取引等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0.3% ●取引コスト*1: 先物のポジションの調整量に対して都度0.005%~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 戦略指数に乘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	組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、信託事務の諸費用、外国での資産の保管等に要する費用、監査費用等が信託財産から支払われます。 ※その他の費用・手数料については、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、上限額等を表示することができません。

※上記手数料等の合計額等については、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。

※税法が改正された場合等には、税込手数料等が変更となることがあります。

【ご注意事項等】

- 当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が作成したものです。
- 当資料は情報提供を目的とするものであり、投資家に対する投資勧誘を目的とするものではありません。
- 当ファンドは、債券等の値動きのある有価証券(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、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。ファンド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。また、投資信託は預貯金とは異なります。
- 当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が信頼できると判断したデータにより作成しておりますが、その内容の完全性、正確性について、同社が保証するものではありません。また掲載データは過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 当資料における内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。
- 投資信託は
 1. 預金・保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、登録金融機関を通して購入した場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
 2. 購入金額については元本保証および利回り保証のいずれもありません。
 3. 投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は投資者のみなさまが負担することとなります。

【委託会社およびその他関係法人】

<委託会社> アセットマネジメントOne株式会社
 <受託会社> みずほ信託銀行株式会社
 <販売会社> 株式会社みずほ銀行
 登録金融機関 関東財務局長(登金)第6号
 加入協会: 日本証券業協会
 一般社団法人金融先物取引業協会
 一般社団法人第二種金融商品取引業協会

【照会先】

アセットマネジメントOne株式会社
 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/>