



ニッセイ・円建てグローバル社債／バランスファンド2025ー06

愛称：まもるとふやす3 特化型

ポートフォリオ構築完了のご報告

当ファンドの商品スキームは特許出願中です（特願2025-90839）（25.05.30）

当ファンドは、複数の外貨建て投資適格社債を裏付けとして円建てで発行される債券(以下「円建て債券」といいます)へ高位に投資し、約5年後の満期まで保有します。信託期間終了時の元本確保をめざすと同時に、実質的に複数の資産に分散投資をすることで高いリターンの獲得をめざす単位型の投資信託です。

2025年6月30日に設定し、このたびポートフォリオの構築が完了しましたので、ご報告いたします。

2025年6月30日時点

基準価額・純資産総額

基準価額	10,000円
純資産総額	122億円

左記は過去の実績であり、将来の運用成果等を保証するものではありません。基準価額は信託報酬控除後、1万口当りの値です。

円建て債券における「積極運用部分」の比率

積極運用部分	3.0%
--------	------

出所)シティグループのデータをもとにニッセイアセットマネジメント作成

VT7指数Ⅱの構成比率

	基本配分	実績※
ナスダック100指数	25.0%	26.1%
米ドル(対円)	15.0%	14.7%
金	10.0%	9.8%
米国国債	0~400%	0.0%
		21.7%

出所)シティグループのデータをもとにニッセイアセットマネジメント作成

VT7指数Ⅱは、4つの資産で構成されます。加えて、年率ボラティリティが7%になることをめざして、全体の投資量を調整します。なお、左記構成比率はボラティリティ・コントロール前の数値です。

※実績は2025年6月30日(設定日)時点の数値です。

ナスダック100指数：米国大型テクノロジー株式トラッカーシリーズ1インデックス、米ドル(対円)：為替JPY 1Mマーケット・トラッカーインデックス、金：コモディティ・ベンチマーク・MONOインデックス・ゴールド、米国国債(短期)：ニッセイUSショートターム・ボンド・トレジャリー・マネージド・インデックス、米国国債(長期)：ニッセイUSロングターム・ボンド・トレジャリー・マネージド・インデックス

2025年6月30日時点

「安定運用部分」の状況 <組入上位5銘柄(組入銘柄数：12銘柄)>

	銘柄	国・地域	業種	償還日	クーポン	格付	比率
1	メキシコ石油公社 (ペメックス)	メキシコ	エネルギー	2030/01/23	6.840%	BBB	22.0%
2	プロサス	中国	通信	2030/01/21	3.680%	BBB	15.0%
	AIRCASTLE / IRELAND DAC	アメリカ	金融会社	2030/03/15	5.250%	BBB-	15.0%
	ソシエテ・ ジェネラル	フランス	銀行	2030/01/22	3.000%	BBB	15.0%
5	ボーイング	アメリカ	資本財	2030/05/01	5.150%	BBB-	10.0%

出所)シティグループのデータをもとにニッセイアセットマネジメント作成

国・地域、業種はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。格付は、ムーディーズ、S&Pのうち、上位の格付を採用しております。比率は対組入債券評価額比。

「安定運用部分」の裏付け資産として組み入れている投資適格社債の上位5銘柄です。

<組入上位2銘柄のご紹介>

メキシコ石油公社(ペメックス)

石油およびガスの探鉱、生産を行う石油・ガス会社。パイプライン輸送、石油化学品販売・輸送センター、物流、および燃料商業化サービスを手掛ける。

プロサス

世界各地で事業を展開するインターネットサービス会社。インターネット、デジタルメディア、ネット通販、および消費者向けインターネット企業への投資に注力する。

上記は特定の銘柄を推奨するものではなく、また、当該銘柄の保有を保証するものではありません。

投資リスク

※詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)の内容を十分にお読みください。

基準価額の変動要因

- 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、基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。
- 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。

主な変動要因

安定運用部分に関するリスク		「安定運用部分」では、ファンドの信託期間終了時の元本※確保をめざす運用を行いますが、以下のリスクがあるため、信託期間中にファンドを換金した時や信託期間終了時に投資した元本を下回る場合があります。 ※元本は購入時手数料を考慮しません。
	債券投資リスク	債券の金利は、景気や経済の状況等の影響を受け変動し、それにともない債券価格も変動します。一般に金利が上昇した場合には、債券の価格が下落します。債券の発行体が財政難・経営不振、資金繰り悪化等に陥り、債券の利息や償還金をあらかじめ定められた条件で支払うことができなくなる場合(債務不履行)、またはそれが予想される場合、債券の価格が下落することがあります。
	為替変動リスク	投資対象とする円建て債券では、原則として実質的にファンドの信託期間(約5年)に応じた長期間での為替ヘッジ(対円)を行うことにより、為替変動リスクの低減をめざします。ただし、当該取引により、信託期間中における為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、信託期間中は金利等の変動により当該取引にかかる評価損益が変動し、ファンドの基準価額を変動させる要因となります。
積極運用部分に関するリスク		「積極運用部分」では、シティグループが算出するVT7指数Ⅱに投資し、同指数は、米国の株価指数先物取引、米国の国債先物取引、米ドル円の為替フォワード取引および金先物取引等で構成されます。そして、少額の資金で大きな収益の獲得をめざすレバレッジ取引を活用します。このため、以下のリスクがあります。
	価格変動リスク	VT7指数Ⅱの実質的な構成対象国・地域の経済情勢、資本規制、税制、取引規制また対円での為替変動等の要因によって指数は変動します。指数が下落する場合、ファンドの資産価値が減少する要因となることがあります。
	レバレッジリスク	VT7指数Ⅱの日次騰落率にレバレッジをかけるため、VT7指数Ⅱの日次騰落率の動きに比べファンドの値動きは大きくなる可能性があります。
	戦略リスク	「積極運用部分」の投資元本が棄損し、投資元本が減少したのちにVT7指数Ⅱが上昇する局面においては、当初想定していた運用成果に比べ、その上昇幅は緩やかになる可能性があります。 VT7指数Ⅱが一日で一定程度※下落した場合は、「積極運用部分」の評価額はゼロとなり、ファンドの信託期間終了時まで円建て債券は「安定運用部分」のみでの運用となります。 ※一定程度の水準については、運用状況等により変動するため事前に記載することはできません。
	繰上償還リスク	シティグループやコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドなどのファンドが投資対象とする円建て債券の組成・運用に係る会社が経営破綻するなどにより当該債券が存続しないこととなる場合には、ファンドは繰上償還となります。また、委託会社(ニッセイアセットマネジメント)とシティグループとのVT7指数Ⅱにかかる契約終了等の事由により同指数を使用できなくなることを要因として、円建て債券が同債券の運用方針にそった運用ができず存続しないこと(同債券の繰上償還)となる場合には、ファンドは繰上償還となります。
	流動性リスク	投資対象資産の市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。

■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。

その他の留意点

- ファンドが実質的な投資対象とする外貨建て投資適格社債には、一般社団法人投資信託協会規則に定める寄与度が10%を超える、またはを超える可能性の高い支配的な銘柄が存在するため、特定の銘柄への投資が集中することがあり、当該銘柄の発行体等に経営破綻や経営・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。
- 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。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。この場合、当該元本の一部払戻しに相当する金額についても課税されます。
- ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要がある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、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ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け付けを取消しする可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。
- ファンドのお取引に関しては、クーリング・オフ(金融商品取引法第37条の6の規定)の適用はありません。

ファンドの費用

お買い付けのお申込みはできません。

投資者が直接的に負担する費用		
購入時	購入時手数料	当該投資信託の募集期間は終了しました。
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 0.3% 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 (信託報酬)	ファンドの元本総額に 年率0.902%(税抜0.82%) をかけた額とし、ファンドからご負担いただきます。
	監査費用	ファンドの元本総額に年率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	その他の費用・ 手数料	● ファンドが投資対象とする円建て債券の発行時に、100,000米ドル程度の費用がかかります。また、VT7指数Ⅱの維持・管理および「積極運用部分」が「安定運用部分」を棄損させないための費用として、毎日、VT7指数Ⅱの日次収益率に対し年率1.5%が控除されます。この年率1.5%の控除率には、VT7指数Ⅱの資産構成を指図する役務としてニッセイアセットマネジメントが受取る年率0.15%の対価が含まれています。その他、VT7指数Ⅱ内における取引等の費用がかかりますが、当該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。なお、当該債券の価格は、これらの費用を控除したのちに算出されます。 ● 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。
- ❗ 詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

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。
- 当資料のいかなる内容も将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。また、資金動向、市況動向等によっては方針通りの運用ができない場合があります。
- 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。

シティグループおよびコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドの免責条項

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。「ニッセイ・円建てグローバル社債／バランスファンド2025ー06」(以下「本商品」といいます)は、シティグループまたはコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドによって支援、承認、販売または促進されておらず、またシティグループおよびコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドは、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。シティグループおよびコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドは、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、シティグループおよびコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッドは、シティグループまたはコンチェルト・インベストメント・コーポレーション・リミテッド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。

取扱販売会社一覧

※詳しくは、販売会社または委託会社の照会先までお問合せください。

取 扱 販 売 会 社 名	金融商品 取引業者	登録金融 機関	登 録 番 号	日本証券業 協会	一般社団法人 日本投資 顧問業協会	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
あかつき証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第67号	○	○	○	
岡三証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第53号	○	○	○	○
香川証券株式会社	○		四国財務局長(金商)第3号	○			
静銀ティーエム証券株式会社	○		東海財務局長(金商)第10号	○			
大熊本証券株式会社	○		九州財務局長(金商)第1号	○			
東洋証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第121号	○			○

委託会社【ファンドの運用の指図を行います】	ファンドに関するお問合せ先
ニッセイ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369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	ニッセイアセットマネジメント株式会社 コールセンター：0120-762-506 (9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く) ホームページ： https://www.nam.co.jp/
受託会社【ファンドの財産の保管および管理を行います】	
三菱UFJ信託銀行株式会社	

