

使用開始日
2024年5月25日

One 日本株ダブル・ ブルファンド2

追加型投信／国内／株式／特殊型(ブル・ベア型)

| 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 | 特殊型 |
| 追加型 | 国内 | 株式 | 特殊型 (ブル・ベア型) | その他資産 (株価指数先物取引) | 年1回 | 日本 | ブル・ベア型 |

◆上記の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

この目論見書により行う「One 日本株ダブル・ブルファンド2」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2024年5月24日に関東財務局長に提出しており、2024年5月25日にその効力が生じております。

- 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。
- ファンドの内容に関して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(2024年2月末現在)
運用する投資信託財産の合計純資産総額:18兆9,352億円
(2024年2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]

株式会社りそな銀行

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

わが国の株価指数を対象とした先物取引(以下「株価指数先物取引」といいます。)を積極的に活用することで、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きに対して概ね2倍程度となることを目指して運用を行います。

ファンドの特色

主として株価指数先物取引を利用し、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きに対して概ね2倍程度となることを目指して運用を行います。

- 本邦通貨建の公社債ならびに金融商品に投資するとともに、株価指数先物取引の買い建てを行います。なお、株式を組み入れる場合があります。
- 株価指数先物取引の買建額と株式の組入額を合計した額が、原則として信託財産の純資産総額の2倍程度となるように調整を行います。
- 当ファンドが利用する株価指数先物取引の種類は、流動性、効率性などを勘案して決定します。

当方は、主として国内上場の日経平均株価(日経225)を対象とした株価指数先物取引を利用します。

なお、市場動向などの変化に対応して流動性や効率性などを考慮し、東証株価指数(TOPIX)を対象とした先物取引、シンガポール取引所(SGX)上場の日経225株価指数先物取引(SGX Nikkei 225 Index Future)などを利用することがあります。

- 追加設定・換金がある場合、設定金額と換金金額の差額分に対して、原則として当日中に株価指数先物取引により対応します。ただし、資産が純増する場合で、その金額が当日の純資産総額を超えている(純資産が倍増以上となる)場合は、原則としてその超過分は翌営業日に対応します。この場合、日々の基準価額の値動きが株式市場の値動きの2倍程度とならない可能性が高くなります。

当ファンドは、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きに対して概ね2倍程度とならない場合があります。当ファンドは株式市場の概ね2倍程度の値動きをすることや、一定の投資成果を保証するものではありません。

運用プロセス

主要投資対象

- ・わが国の株価指数先物および本邦通貨建の公社債ならびに金融商品

取引数量の決定

- ・運用は主として株価指数先物の買い建てにより行います。株式を組み入れる場合があります。
- ・株価指数先物の買建額と株式の組入額を合計した額については、原則として信託財産の純資産総額の概ね2倍程度になるよう調整を行います。
- ・時価変動、資金動向などを加味して、株価指数先物の建玉調整枚数を算出します。

売買の実施

- ・必要な株価指数先物の建玉調整枚数を売買します。

※運用プロセスは、2024年2月末時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

追加的記載事項

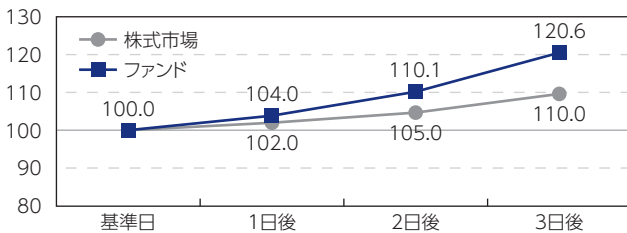
基準価額の変動に関するQ&A

Q1:基準価額の値動きは株式市場の値動きに対して常に概ね2倍程度となるのですか。

A1:基準価額の値動きが株式市場の値動きの概ね2倍程度となるのは前日と比較した場合です。前日との比較において概ね2倍程度となることを目指して運用を行います。2日以上離れた日と比較した場合、概ね2倍程度の投資成果が得られるわけではありません。また、株式市場が上昇・下落をした場合には、一方に上昇または下落した場合よりも低い投資成果となっています。

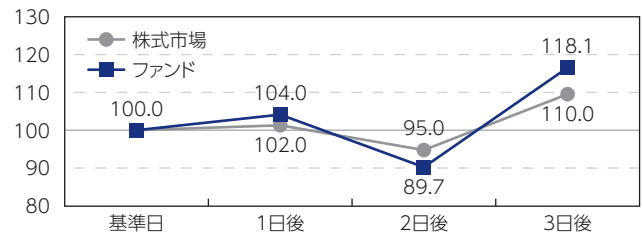
株式市場が一方向に上昇した場合

| | 基準日 | 1日後 | 2日後 | 3日後 | |
|------------|---------|-------|-------|-------|-------|
| 株式市場 | 100.0 | 102.0 | 105.0 | 110.0 | |
| ファンド | 100.0 | 104.0 | 110.1 | 120.6 | |
| 前日との騰落率比較 | 株式市場(A) | - | 2.0% | 2.9% | 4.8% |
| | ファンド(B) | - | 4.0% | 5.9% | 9.5% |
| | 倍率(B/A) | - | 2.0 | 2.0 | 2.0 |
| 基準日との騰落率比較 | 株式市場(C) | - | 2.0% | 5.0% | 10.0% |
| | ファンド(D) | - | 4.0% | 10.1% | 20.6% |
| | 倍率(D/C) | - | 2.0 | 2.0 | 2.1 |



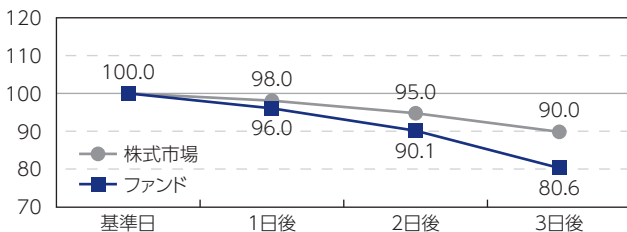
株式市場が上昇・下落後に上昇した場合

| | 基準日 | 1日後 | 2日後 | 3日後 | |
|------------|---------|-------|------|--------|-------|
| 株式市場 | 100.0 | 102.0 | 95.0 | 110.0 | |
| ファンド | 100.0 | 104.0 | 89.7 | 118.1 | |
| 前日との騰落率比較 | 株式市場(A) | - | 2.0% | -6.9% | 15.8% |
| | ファンド(B) | - | 4.0% | -13.7% | 31.6% |
| | 倍率(B/A) | - | 2.0 | 2.0 | 2.0 |
| 基準日との騰落率比較 | 株式市場(C) | - | 2.0% | -5.0% | 10.0% |
| | ファンド(D) | - | 4.0% | -10.3% | 18.1% |
| | 倍率(D/C) | - | 2.0 | 2.1 | 1.8 |



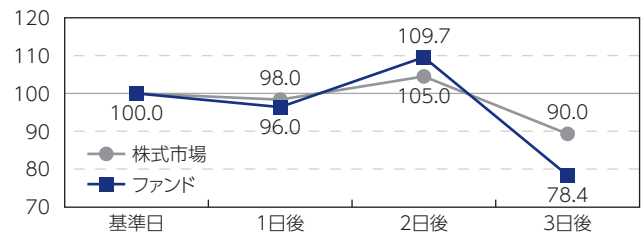
株式市場が一方向に下落した場合

| | 基準日 | 1日後 | 2日後 | 3日後 | |
|------------|---------|------|-------|-------|--------|
| 株式市場 | 100.0 | 98.0 | 95.0 | 90.0 | |
| ファンド | 100.0 | 96.0 | 90.1 | 80.6 | |
| 前日との騰落率比較 | 株式市場(A) | - | -2.0% | -3.1% | -5.3% |
| | ファンド(B) | - | -4.0% | -6.1% | -10.5% |
| | 倍率(B/A) | - | 2.0 | 2.0 | 2.0 |
| 基準日との騰落率比較 | 株式市場(C) | - | -2.0% | -5.0% | -10.0% |
| | ファンド(D) | - | -4.0% | -9.9% | -19.4% |
| | 倍率(D/C) | - | 2.0 | 2.0 | 1.9 |



株式市場が下落・上昇後に下落した場合

| | 基準日 | 1日後 | 2日後 | 3日後 | |
|------------|---------|------|-------|-------|--------|
| 株式市場 | 100.0 | 98.0 | 105.0 | 90.0 | |
| ファンド | 100.0 | 96.0 | 109.7 | 78.4 | |
| 前日との騰落率比較 | 株式市場(A) | - | -2.0% | 7.1% | -14.3% |
| | ファンド(B) | - | -4.0% | 14.3% | -28.6% |
| | 倍率(B/A) | - | 2.0 | 2.0 | 2.0 |
| 基準日との騰落率比較 | 株式市場(C) | - | -2.0% | 5.0% | -10.0% |
| | ファンド(D) | - | -4.0% | 9.7% | -21.6% |
| | 倍率(D/C) | - | 2.0 | 1.9 | 2.2 |



※上記の数値は小数第2位を四捨五入しています。

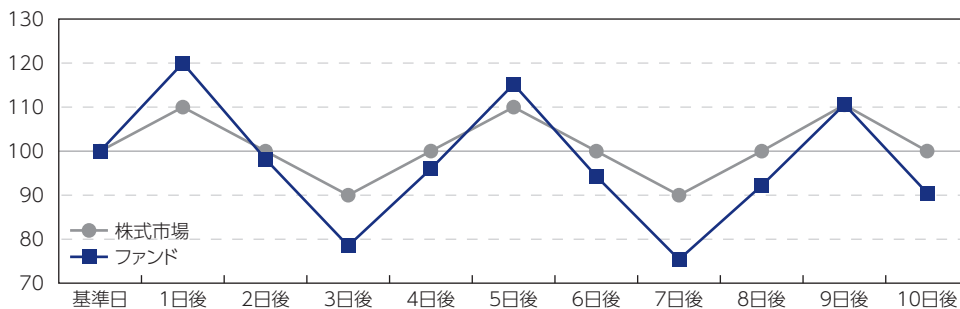
※上記各表およびグラフは、株式市場の値動きとファンドの基準価額の値動きの関係をわかりやすく説明するために例示およびイメージ化したものであり、株式市場やファンドの基準価額の値動きを示唆、保証するものではありません。



ファンドの目的・特色

Q2: 株式市場の動き方によって、基準価額の動き方や水準はどのようになりますか。

A2: 株式市場が上昇・下落を繰り返して元の水準に戻ったとしても、ファンドの基準価額は元に戻らず、基準価額の水準が押し下げられます。このように株式市場が上昇・下落を繰り返して動く場合、ファンドにとってマイナス要因となります。結果として、**株式市場が上昇と下落を長期間繰り返した後に元の水準へ戻る場合、または元の水準より高くなった場合においても、基準価額は元の水準より低くなる場合があります。**



※左記表およびグラフは、株式市場の値動きとファンドの基準価額の値動きの関係性をわかりやすく説明するために例示およびイメージ化したものであり、株式市場やファンドの基準価額の値動きを示唆、保証するものではありません。

| | | | | | | | | | | | |
|------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|
| 株式市場 | 100.0 | 110.0 | 100.0 | 90.0 | 100.0 | 110.0 | 100.0 | 90.0 | 100.0 | 110.0 | 100.0 |
| ファンド | 100.0 | 120.0 | 98.2 | 78.5 | 96.0 | 115.2 | 94.3 | 75.4 | 92.2 | 110.6 | 90.5 |

投資におけるリスク・留意点

- ◆当ファンドは、日々の基準価額の値動きが株式市場の値動きの「概ね2倍程度」となることを目指して運用するため、株価指数先物取引を積極的に活用します。したがって、日々の基準価額が非常に大きく変動する性質があります。
- ◆当ファンドは、以下の理由から、**一般的に中長期の投資には向かない金融商品です。**

- ・当ファンドは、日々の基準価額の値動きが株式市場の値動きの「概ね2倍程度」となることを目指しており、2日以上以上の期間の値動きに対しては「概ね2倍程度」となりません(前述Q1参照)。また、当ファンドは株式市場との連動を目指すインデックスファンドではありません。
- ・当ファンドの基準価額は、株式市場が上昇・下落を繰り返した場合、時間の経過とともに押し下げられる傾向があります。株式市場が上昇と下落を繰り返しながら推移した場合、一定期間後に株式市場が同じ水準になったとしても、基準価額は元の水準に戻らない可能性があります(前述Q2参照)。

- ◆当ファンドは、以下の要因などにより日々の基準価額の値動きが株式市場の値動きの「概ね2倍程度」とならない場合があります(下記以外にも「概ね2倍程度」とならない要因があります。)

- ① 株価指数先物と株式市場の値動きが一致しない場合
- ② 日々の追加設定・換金などに対応した株価指数先物取引の約定価格と終値に差が生じた場合
- ③ 株式市場の大幅な変動や急激な変動の場合、またそれにより先物取引が成立せず、必要な取引数量のうち全部または一部が取引不成立となった場合
- ④ 先物の限月^(※1) 交代に対応するロールオーバーコスト^(※2) の発生
- ⑤ 追加設定・換金などにより運用資産に大幅な増減が生じる場合
- ⑥ ファンドの資産規模が少額のため株価指数先物取引の組入比率を適切に調整できない場合
- ⑦ 運用管理費用(信託報酬)、売買委託手数料などのコスト負担の影響
- ⑧ 異常な価格変動時などにおいて、委託会社の判断により、一時的に株価指数先物取引の買建額を減じた場合

など

※1: 限月とは先物取引の期限が満了となる月をいいます。限月交代とは取引の中心となっている限月が次の限月に入れ替わることです。

※2: ロールオーバーコストとは、保有する先物取引を次の限月に乗り換えるため決済する一方、新たな先物取引を行う(ロールオーバーする)ことで発生するコストをいいます。



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は行いません。
- ◆ 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。

■ 分配方針

年1回の決算時(毎年8月25日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた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。)等の全額を対象として、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。



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に投資し、株価指数先物取引を積極的に活用しますので、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。

株価変動 リスク

株式市場の下落(株価指数先物[買建]の価格の下落)は基準価額の下落要因です。

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係等の影響を受け変動します。当ファンドは、株価指数先物取引の買い建てを積極的に活用しますので、株式市場が下落した場合は、基準価額が大きく下落します。

信用 リスク

投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。

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有価証券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合、信用格付けが格下げされた場合等には、有価証券の価格が下落したり、その価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

流動性 リスク

投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす要因となります。

金利変動 リスク

金利の上昇(公社債の価格の下落)は、基準価額の下落要因となります。

金利の変動は、公社債等の価格に影響を及ぼします。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。

※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。



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。
 - ・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと、受益者毎に異なります。
 - ・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。
- 当ファンドは、日々の基準価額の値動きが株式市場の値動きの「概ね2倍程度」となることを目指しており、2日以上の間隔の値動きに対しては「概ね2倍程度」となりません。当ファンドの基準価額は、株式市場が上昇・下落を繰り返した場合、時間の経過とともに押し下げられる傾向があります。株式市場が上昇と下落を繰り返しながら推移した場合、一定期間後に株式市場が同じ水準になったとしても、基準価額は元の水準に戻らない可能性があります。

また、当ファンドは株価指数先物取引を積極的に活用するため、先物取引に関するコストや日々の運用管理費用(信託報酬)等のコスト負担の影響を受け、基準価額が押し下げられる要因となります。したがって、投資期間が長期にわたる場合には、これらのコスト負担が大きくなり、投資成果に大きな影響を与えます。

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コンプライアンス・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、運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、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。

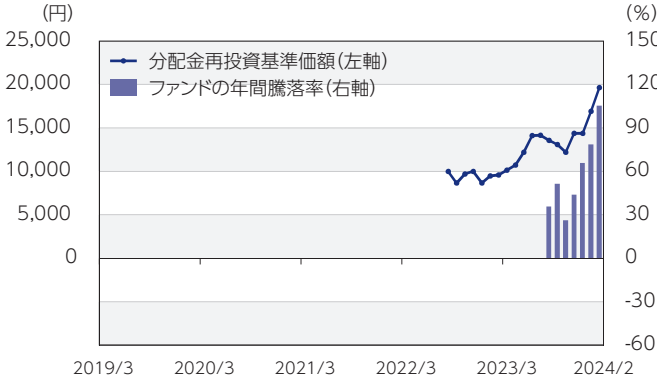
※リスク管理体制は、今後変更になることがあります。



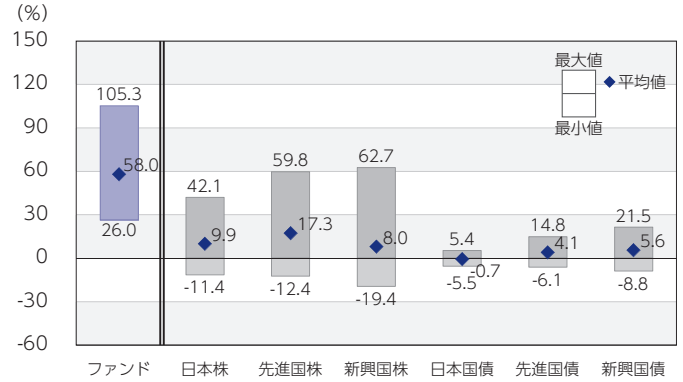
投資リスク

<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



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:2023年8月~2024年2月

代表的な資産クラス:2019年3月~2024年2月

- *ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- *ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

- *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準または商標は、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準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・ディバースィファイド (円ベース) | 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」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。 |

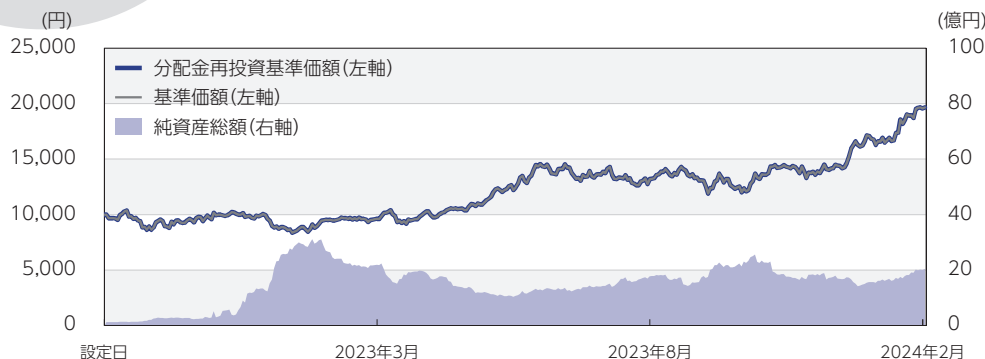
(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。



運用実績

データの基準日:2024年2月29日

基準価額・純資産の推移 (2022年8月31日~2024年2月29日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2022年8月31日)

分配の推移 (税引前)

| | |
|----------|----|
| 2023年 8月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、国/地域を表します。

資産の状況

| 資産の種類 | 比率(%) |
|-----------------------|--------|
| 国債証券 | 56.65 |
| 内 日本 | 56.65 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 43.35 |
| 合計(純資産総額) | 100.00 |

組入銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国/地域 | 利率(%) | 償還日 | 比率(%) |
|----|--------------|------|------|-------|-----------|-------|
| 1 | 1203回 国庫短期証券 | 国債証券 | 日本 | - | 2024/4/4 | 28.08 |
| 2 | 1209回 国庫短期証券 | 国債証券 | 日本 | - | 2024/5/7 | 9.85 |
| 3 | 1208回 国庫短期証券 | 国債証券 | 日本 | - | 2024/4/22 | 7.88 |
| 4 | 1213回 国庫短期証券 | 国債証券 | 日本 | - | 2024/5/27 | 5.42 |
| 5 | 1212回 国庫短期証券 | 国債証券 | 日本 | - | 2024/5/20 | 5.42 |

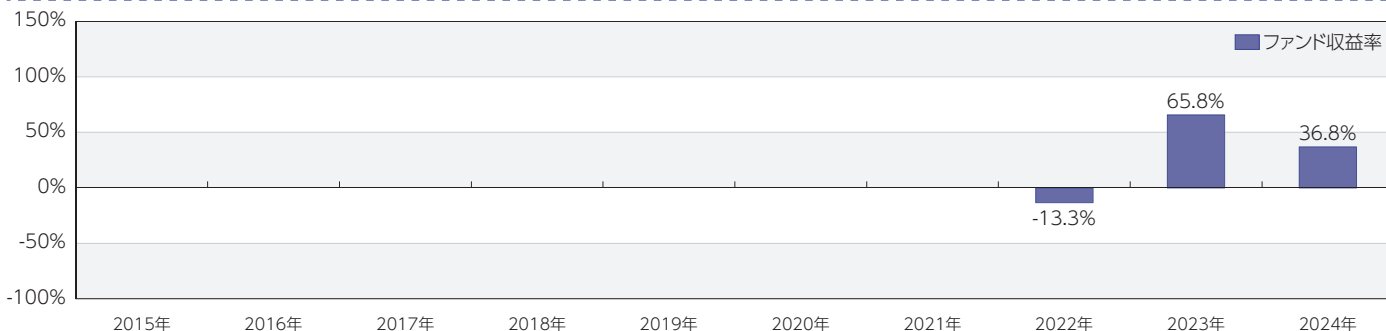
その他資産の投資状況

| 資産の種類 | 比率(%) |
|--------------|--------|
| 株価指数先物取引(買建) | 203.04 |

組入銘柄

| 順位 | 資産の名称 | 買建/売建 | 比率(%) |
|----|----------------|-------|--------|
| 1 | NK225 先物 0603月 | 買建 | 203.04 |

年間収益率の推移 (暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2022年は設定日から年末までの収益率、および2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



手続・手数料等

お申込みメモ

| | |
|--------------------|--|
| 購入単位 | 販売会社が定める単位(当初元本1口=1円) |
| 購入価額 | 購入申込受付日の基準価額(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 | 販売会社が定める単位 |
| 換金価額 | 換金申込受付日の基準価額 |
| 換金代金 | 原則として換金申込受付日から起算して4営業日目からお支払いします。 |
| 申込締切時間 | 原則として営業日の午後2時45分以前で販売会社が定める申込締切時間までに販売会社が受けたものを当日分のお申込みとします。 ※申込締切時間は2024年11月5日より午後3時15分以前で販売会社が定める申込締切時間までとなる予定です。 |
| 購入の申込期間 | 2024年5月25日から2024年11月26日まで ※申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。 |
| 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。 |
| 購入・換金申込受付の中止および取消し | 株価指数先物取引のうち当ファンドが主として取引を行うものについて次の事象が発生したとき、金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・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購入・換金のお申込みの受付を取り消す場合があります。 <ul style="list-style-type: none">•当該先物取引にかかる金融商品取引所の当日の立会の全部または一部が行われないときもしくは停止されたとき•当該先物取引にかかる金融商品取引所の当日の立会終了時における当該先物取引の呼値が当該金融商品取引所が定める呼値の値幅の限度の値段とされるなどやむを得ない事情が発生したことから、当ファンドの当該先物取引にかかる呼値の取引数量の全部もしくは一部についてその取引が成立しないとき |
| 信託期間 | 2027年8月25日まで(2022年8月31日設定) |
| 繰上償還 | 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。 <ul style="list-style-type: none">•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•純資産総額が30億円を下回ることとなった場合•やむを得ない事情が発生した場合 |
| 決算日 | 毎年8月25日(休業日の場合は翌営業日) |
| 収益分配 | 年1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。 |



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、 2.2%(税抜2.0%) 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 | ありません。 | | | | | | | | | | | | |
| 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) | <p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.935%(税抜0.85%) 信託報酬＝運用期間中の基準価額×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、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>支払先</th> <th>内訳(税抜)</th> <th>主な役務</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>委託会社</td> <td>年率0.50%</td> <td>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</td> </tr> <tr> <td>販売会社</td> <td>年率0.30%</td> <td>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</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>年率0.05%</td> <td>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</td> </tr> </tbody> </table> | 支払先 | 内訳(税抜) | 主な役務 | 委託会社 | 年率0.50% | 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0.05% | 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 |
| | 支払先 | 内訳(税抜) | 主な役務 | | | | | | | | | | |
| | 委託会社 | 年率0.50% | 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0.05% | 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 | | | | | | | | | | | |
| その他の費用・手数料 | <p>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。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・組入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 ・先物取引・オプション取引等に要する費用 ・監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 等 <p>監査費用は毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および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。</p> <p>※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。</p> | | | | | | | | | | | | |

※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。

■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 普通分配金に対して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2024年2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。



手続・手数料等

… (参考情報) ファンドの総経費率 …

| 総経費率(①+②) | 運用管理費用の比率① | その他費用の比率② |
|-----------|------------|-----------|
| 0.93% | 0.93% | 0.00% |

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2022年8月31日～2023年8月25日

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。

※なお、当ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。