

2025年12月26日

株式組入比率を調整し基準価額の下落の抑制と反動高をとらえる運用をめざす 「ニッセイ／FOLIO ねらってそなえる日経225」 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／FOLIO ねらってそなえる日経225」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「ニッセイ日経225インデックスマザーファンド」への投資を通じて実質的に国内の株式に投資を行うとともに、定量モデルに基づき市場環境に応じた実質的な株式組入比率をコントロールし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

商 品 名：ニッセイ／FOLIO ねらってそなえる日経225

商 品 分 類：追加型投信／国内／株式

当 初 申 込 期 間：2026年1月19日から2026年1月29日まで

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：株式会社SBI証券

■ ファンドの特色

① 国内の株式に投資します。

- 主として「ニッセイ日経225インデックスマザーファンド」と「日経225先物」を投資対象とします。
 - ニッセイ日経225インデックスマザーファンドは、配当込みの日経平均株価(日経225)^{*}の値動きを示す「日経平均トータルリターン・インデックス」の動きに連動する投資成果をめざすファンドです。
※ 日経平均株価(日経225)を以下「日経平均株価」ということがあります。
 - 日経225先物は、日経平均株価を対象とした株価指数先物取引です。

② 実質的な株式の組入比率については「日経225先物」を活用し、0～100%の範囲内で調整します。

- 原則として実質的な株式組入比率をおおむね100%とします。
- 定量モデルに基づき、日経平均株価の下落を見込む局面では、実質的な株式の組入比率を引下げます。また、日経平均株価の極端な下落局面では、実質的な株式の組入比率を短期的に引上げることがあります。これらにより、基準価額の下落リスクの低減と信託財産の中長期的な成長をめざします。

③ 組入比率の調整にあたってはニッセイアセットマネジメントの定量モデルとFOLIOグループのAI技術を活用します。

<FOLIOグループについて>

株式会社FOLIOホールディングスの傘下である株式会社FOLIOとAlpacaTech株式会社の強力な事業シナジーのもと、AI(人工知能)やテクノロジーを活用した高度な金融ソリューションを提供しています。

④ 年1回決算を行います。信託財産の十分な成長に資することに配慮し、分配を抑制する方針です。

- 毎年2月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。
 - 初回決算日は、2027年2月15日とします。

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。

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。



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—



■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。 ②継続申込期間：購入申込受付日の基準価額とします。
換金価額	換金申込受付日の基準価額とします。
換金代金	換金申込受付日から起算して、原則として5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。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。
信託期間	2046年2月15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できます。
決算日	2月15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、当ファンドは、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」の対象となります。ただし、販売会社により取扱いが異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。

■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	購入申込受付日の基準価額(当初申込期間：1口当たり1円)に3.3%(税抜3.0%)を上限として販売会社が独自に定める率をかけた額とします。 ● 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	ありません。
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)	ファンドの純資産総額に年率1.089%(税抜0.99%)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	その他の費用・ 手数料	組入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、主に国内の株式を投資対象としますので、組入株式の価格の下落、組入株式の発行会社の倒産または財務状況の悪化等の影響により、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。
- 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、「株式投資リスク」、「モデル運用に関するリスク」、「株価指数先物の活用に関するリスク」、「株式組入比率のコントロールに関するリスク」、「流動性リスク」などがあります。

■ 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のとなります。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。

<「日経平均株価(日経225)」および「日経平均トータルリターン・インデックス」の著作権等について>

- ① 「日経平均株価(日経225)」および「日経平均トータルリターン・インデックス」(以下「各指数」といいます)は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、各指数自体および各指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- ② 「日経」および各指数を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべて株式会社日本経済新聞社に帰属しています。
- ③ 当ファンドは、ニッセイアセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。
- ④ 株式会社日本経済新聞社は、各指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。
- ⑤ 株式会社日本経済新聞社は、各指数の構成銘柄、計算方法、その他各指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。