

第6期末（2026年7月10日）

基準価額 10,740円

純資産総額 415百万円

第1期～第6期 (2026年1月30日～2026年7月10日)

騰落率 7.4%

分配金合計 0円

(注) 騰落率は分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

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/>

お客様の口座内容に関するご照会は、
お申し込みされた販売会社にお問い合わせください。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

ニッセイ米国株式 ブースト戦略ファンド (毎月決算・ 予想分配金提示型)

追加型投信／海外／株式

運用報告書（全体版）

作成対象期間：2026年1月30日～2026年7月10日

第1期（決算日2026年2月10日） 第4期（決算日2026年5月11日）
第2期（決算日2026年3月10日） 第5期（決算日2026年6月10日）
第3期（決算日2026年4月10日） 第6期（決算日2026年7月10日）

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド（毎月決算・予想分配金提示型）」は、このたび第6期の決算を行いました。

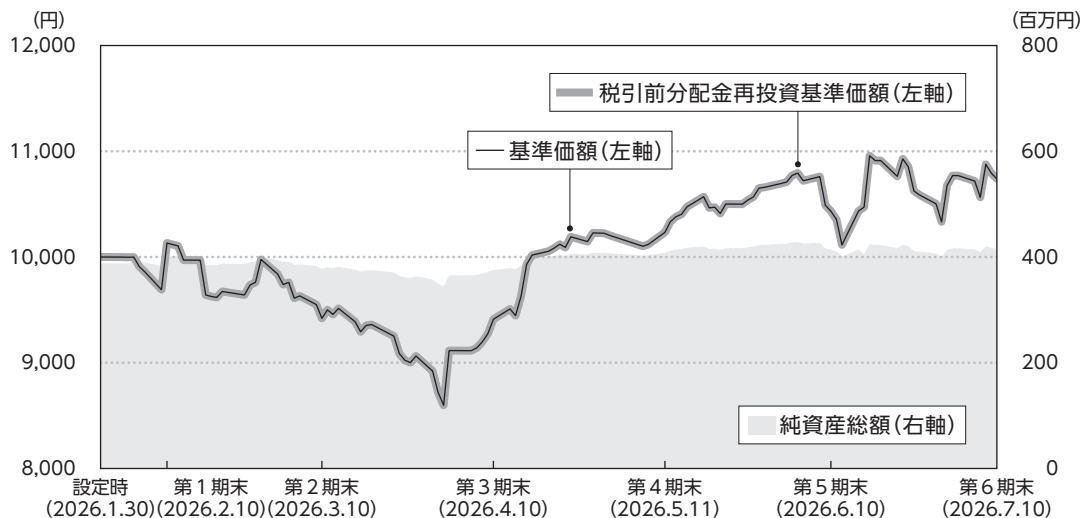
当ファンドは、「レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ（ケイマン）トラストーUSエクイティ・プラス・ロング・コール・ストラテジーファンド（クラスA）」への投資を通じて、実質的にS&P500指数を原資産とする先物取引とオプション取引を行うとともに、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受をめざすことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

運用経過

2026年1月30日～2026年7月10日

基準価額等の推移



設定時	10,000円	既払分配金	0円
第6期末	10,740円	騰落率（分配金再投資ベース）	7.4%

（注1）税引前分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、設定時の基準価額にあわせて指数化しています。

（注2）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

（注3）当ファンドはベンチマークを設けていません。

基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・4月以降、中東情勢に対する警戒感の後退や、人工知能（A I）や半導体投資への根強い期待感などを背景に株価が上昇したこと
- ・当作成期を通じて、日米短期金利差の拡大などからおおむね米ドル高円安基調となったこと

<下落要因>

- ・設定時から3月末にかけて、A Iの進化による既存ビジネスのディスラプション（破壊的な変化）やイラン情勢の緊迫化などを背景に株価が下落したこと

1 万口当たりの費用明細

項目	第1期～第6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	60円	0.598%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,018円です。
（投信会社）	(24)	(0.244)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
（販売会社）	(34)	(0.342)	購入後の情報提供、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および事務手続き等の対価
（受託会社）	(1)	(0.012)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
その他費用	9	0.092	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
（監査費用）	(0)	(0.005)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
（その他）	(9)	(0.088)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	69	0.690	

（注1）作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

（注2）金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

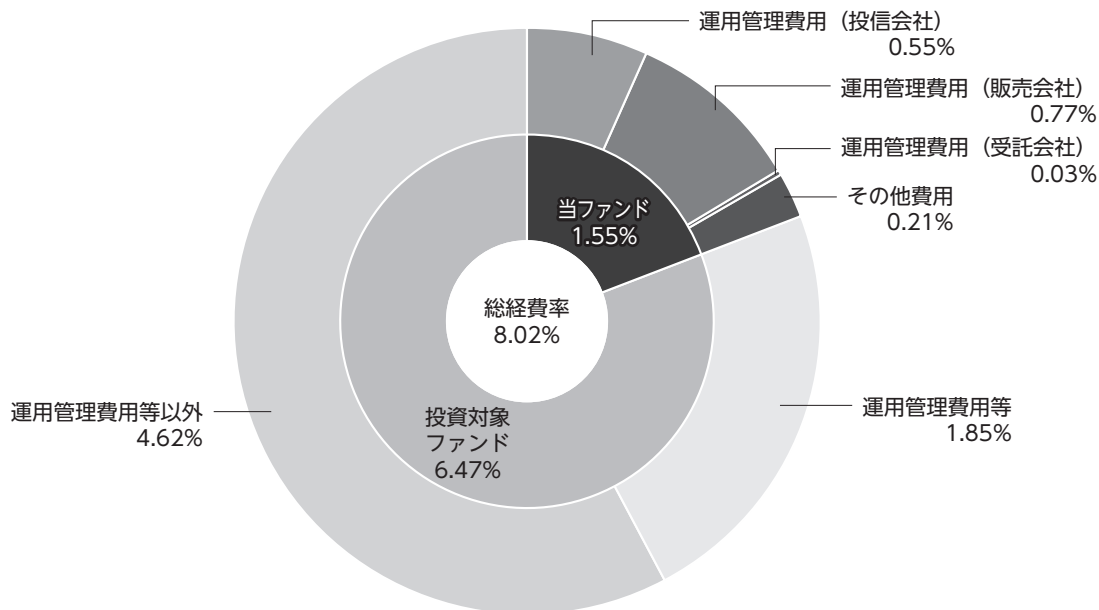
（注3）比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

（注4）各項目の費用は、当ファンドが組み入れている外国投資信託証券が支払った費用を含みません（マザーファンドを除く）。

（参考情報）

■総経費率

作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は8.02%**です。



総経費率（①+②+③）	8.02%
①当ファンドの費用の比率	1.55%
②投資対象ファンドの運用管理費用等の比率	1.85%
③投資対象ファンドの運用管理費用等以外の比率	4.62%

- (注1) ①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- (注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
- (注3) 各比率は、年率換算した値です。
- (注4) 投資対象ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く）です。
- (注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資対象ファンドが支払った費用を含みません。
- (注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- (注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。
- (注8) 投資先ファンドである「レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ（ケイマン）トラストーUSエクイティ・プラス・ロング・コール・ストラテジーファンド（クラスA）」（ケイマン籍外国投資信託証券）は2026年6月に初回決算を迎えておりますが、当ファンドの運用報告書作成時点において、当該投資先ファンドの総経費率は確定していません。そのため、当ファンドの総経費率（年率）の算出にあたっては、当該投資先ファンドの純資産総額を基に委託会社において推計した数値を使用して算出しています。
- (注9) 当作成期中は純資産総額が小規模であったことから、当ファンドの投資対象ファンドの信託財産の監査費用、法律関係の費用や運用管理費用にかかる固定的な費用の影響が大きくなり、総経費率は8.02%となりました。
- (注10) 投資対象ファンドの「運用管理費用等」には、Citigroup Global Markets Limited（シティグループ・グローバル・マーケット・リミテッド）との担保付スワップ契約にかかる先物取引・為替取引およびオプション取引のパフォーマンス（指数値）の算出費用（年率0.3%）が含まれています。

投資環境

■米国株式市況

【S & P 5 0 0 指数の推移】



(注) FactSetのデータを使用しています。

米国株式市場は当作成期を通じて見ると上昇しました。

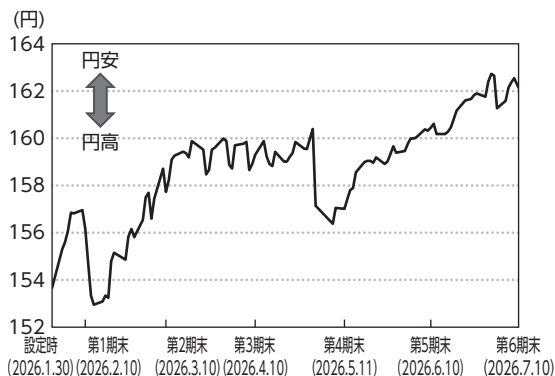
設定時から3月末にかけては、米国・イスラエルとイランの軍事衝突を背景としたエネルギー価格の上昇およびインフレの加速懸念により株価は下落基調で推移しました。

4月に入ると中東情勢に対する過度な警戒感が後退し、AIや半導体投資への根強い期待感などを背景に株価は上昇基調となりました。

6月上旬から当作成期末にかけては、大型ハイテク株の業績見通しが相対的に不振であったため、株価はレンジ圏での推移となりました。

■為替市況

【米ドル／円レートの推移】



(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

為替市場は当作成期を通じて見ると米ドル高円安となりました。

1月の日米当局によるレートチェック（取引状況の照会）を背景とした為替介入への警戒感の高まりや、4月下旬から5月上旬にかけての政府・日銀による為替介入により急速に米ドル安円高となる場面もありましたが、当作成期を通じて見ると、日米短期金利差の拡大などからおおむね米ドル高円安基調となりました。

ポートフォリオ

■当ファンド

外国投資信託証券への投資を通じて、実質的にS & P 500指数を原資産とする先物取引とオプション取引を行うとともに、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受をめざすことにより、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した。

■レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ（ケイマン）トラストー USエクイティ・プラス・ロング・コール・ストラテジーファンド（クラスA）

*シティグループの資料（現地における当作成期末の2営業日前基準）に基づき、ニッセイアセットマネジメントが作成しています。

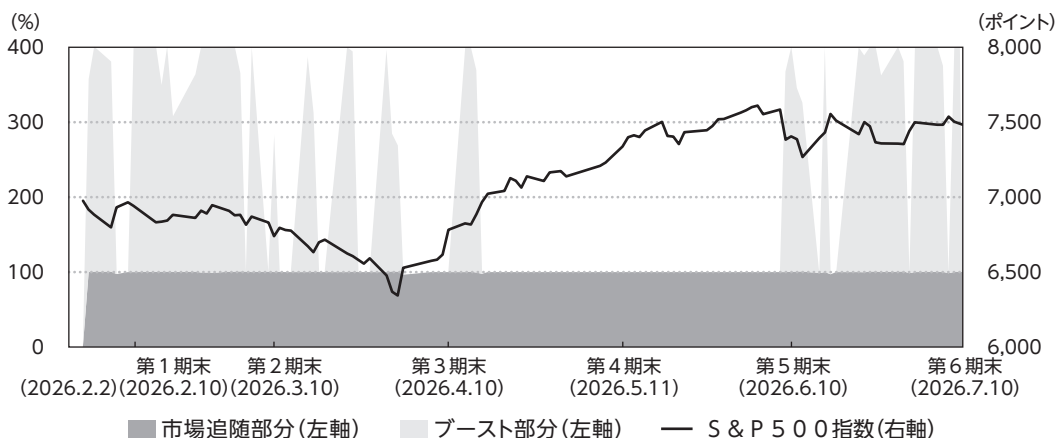
当ファンドの「米国株式ブースト戦略」は、先物取引と為替取引を行う「市場追随部分」とオプション取引を行う「ブースト部分」で構成されます。

【市場追随部分】S & P 500指数を原資産とする先物を買って建てるのと同時に、米ドル買い円売りを実施しました。その結果、米国株式市場の上昇や米ドル高円安の進展によりプラスのリターンを獲得しました。

【ブースト部分】定量的な指標に基づき購入日と購入量を決定し、S & P 500指数を原資産とする翌営業日満期のコールオプションを購入しました。その結果、当作成期はマイナスのリターンとなりました。特に2月、3月において米国株式市場が相対的に軟調な推移となる中、コールオプションのプレミアム支払い分がリターンを引き下げる状況が続きました。一方で3月末から4月中旬にかけては、「下落からの反発を期待したコールオプション買い」や「上昇を期待したコールオプション購入」が機能する場面もありました。

（注）コールオプションとは、特定の商品（株式・通貨など）を特定の価格（権利行使価格）で将来のある期日（オプションの満期日など）に買うことができる権利をいいます。

＜ご参考＞「米国株式ブースト戦略」におけるS & P 500指数への投資比率



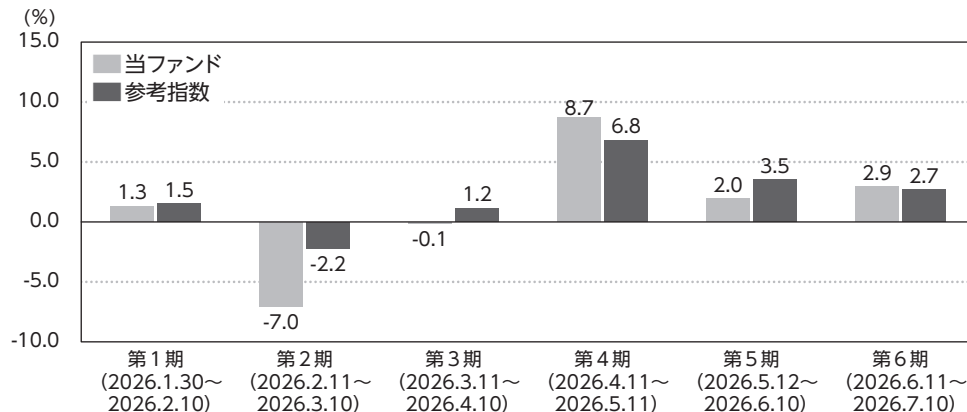
*上記グラフにおける「市場追随部分」は時価ベース、「ブースト部分」は想定元本ベースでの数値です。また、市場追随部分ではファンドが投資対象とする外国投資信託証券の純資産総額と同程度の金額のS & P 500指数先物を買って建てる。ブースト部分ではS & P 500指数コールオプションを購入します。その想定元本の上限はファンドが投資対象とする外国投資信託証券の純資産の300%です。なお、ファンドの評価基準の都合上、各投資比率には2営業日前の市場データが反映されています。これに合わせて、当グラフにおけるS & P 500指数も2営業日前の数値を表示しているため、「投資環境」で記載している同指数の推移とは2営業日のズレが生じます。

*S & P 500指数はFactSetのデータを使用しています。

■ニッセイマネーマーケットマザーファンド

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざしました。

参考指数との差異



当ファンドはベンチマークを設けていません。参考指数はS & P 5 0 0 指数（配当込み、円ベース）です。当作成期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+7.4%となり、参考指数騰落率（+14.0%）を下回りました。

これは「ブースト部分」がマイナスに働いたことなどによるものです。

（注1）基準価額の騰落率は分配金込みです。

（注2）参考指数の詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

分配金

当作成期の分配金は、当運用報告書「当ファンドの概要」に記載した分配方針に基づき、見送らせていただきました。

なお、分配に充てずに信託財産に留保した収益につきましては、元本部分と同一の運用を行います。

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	第1期 2026年1月30日 ～ 2026年2月10日	第2期 2026年2月11日 ～ 2026年3月10日	第3期 2026年3月11日 ～ 2026年4月10日	第4期 2026年4月11日 ～ 2026年5月11日	第5期 2026年5月12日 ～ 2026年6月10日	第6期 2026年6月11日 ～ 2026年7月10日
当期分配金（税引前）	—	—	—	—	—	—
対基準価額比率	—	—	—	—	—	—
当期の収益	—	—	—	—	—	—
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	133円	133円	133円	236円	436円	743円

（注1）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切り捨てで算出しているため、合計が当期分配金と一致しない場合があります。

（注2）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

今後の運用方針

■当ファンド

外国投資信託証券への投資を通じて、実質的にS & P 500指数を原資産とする先物取引とオプション取引を行うとともに、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受をめざすことにより、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。

■レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ（ケイマン）トラスト

USエクイティ・プラス・ロング・コール・ストラテジーファンド（クラスA）

引き続き、担保付スワップ取引を活用し、実質的にS & P 500指数を原資産とする株価指数先物とコールオプション、および米ドル買い円売りの為替取引に投資を行うことで、市場追随部分からS & P 500指数と同程度のリターン獲得およびブースト部分からの積極的な追加リターン獲得をめざします。

■ニッセイマネーマーケットマザーファンド

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

組入ファンド

	第6期末 2026年7月10日
レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ（ケイマン）トラストー USエクイティ・プラス・ロング・コール・ストラテジーファンド（クラスA）	96.7%
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	0.0

（注1）組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

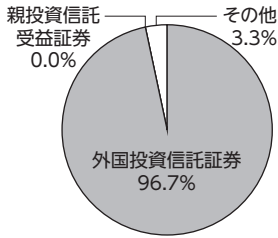
（注2）組入全ファンドを記載しています。

純資産等

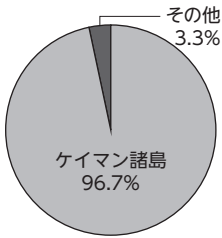
項目	第1期末 2026年2月10日	第2期末 2026年3月10日	第3期末 2026年4月10日	第4期末 2026年5月11日	第5期末 2026年6月10日	第6期末 2026年7月10日
純資産総額	400,634,774円	377,522,885円	375,281,155円	408,063,722円	414,048,075円	415,287,206円
受益権総口数	395,403,768口	400,787,636口	398,787,636口	398,787,636口	396,845,322口	386,680,751口
1万口当たり基準価額	10,132円	9,420円	9,411円	10,233円	10,433円	10,740円

（注）当作成期間（第1期～第6期）中における追加設定元本額は13,712,757円、同解約元本額は15,106,885円です。

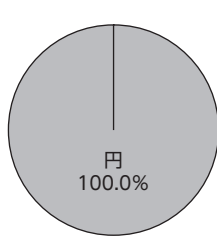
資産別配分



国別配分



通貨別配分



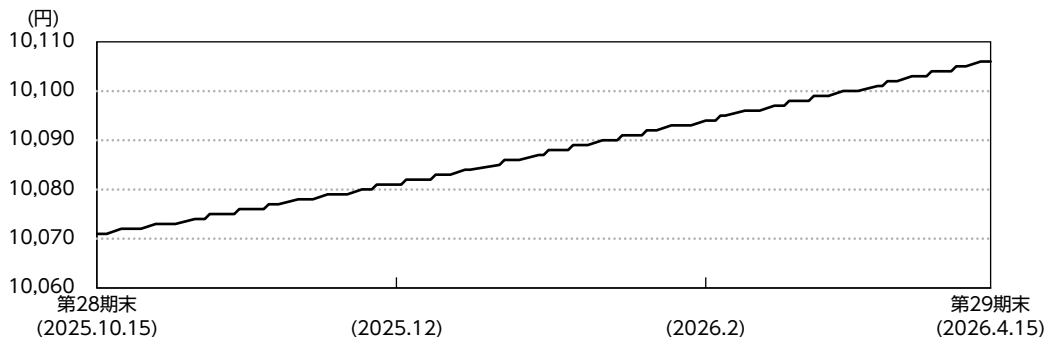
（注）資産別・国別・通貨別配分は、2026年7月10日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

**レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ（ケイマン）トラストー
USエクイティ・プラス・ロング・コール・ストラテジーファンド（クラスA）**

「レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ（ケイマン）トラストーUSエクイティ・プラス・ロング・コール・ストラテジーファンド（クラスA）」（ケイマン籍外国投資信託証券）は開示対象ファンドの運用報告書作成時点において監査済み財務諸表が存在しないことから、記載すべき情報はありません。

ニッセイマネーマーケットマザーファンドの概要

■基準価額の推移



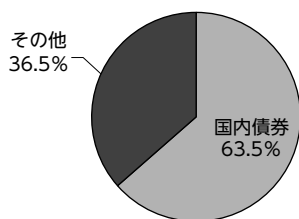
■上位銘柄

銘柄名	通貨	比率
第1回 東京都公募公債 (東京ソーシャルボンド (5年))	円	10.4%
令和3年度第6回 埼玉県公募公債 (5年)	円	10.4
平成28年度第4回 京都市公募公債	円	6.2
第760回 東京都公募公債	円	6.0
平成28年度第1回 静岡市公募公債	円	6.0
第160回 共同発行市場公募地方債	円	5.7
第291回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	円	3.8
第158回 共同発行市場公募地方債	円	3.8
第756回 東京都公募公債	円	3.8
平成28年度第5回 愛知県公募公債	円	3.8
組入銘柄数	11	

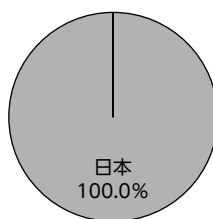
■1万口当たりの費用明細

当期（2025年10月16日～2026年4月15日）における費用はありません。

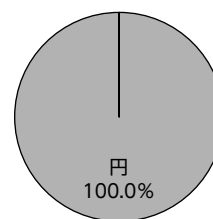
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2026年4月15日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分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。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書（全体版）の組入有価証券明細表をご参照ください。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額＋ 累計分配金	参考指数	期中 騰落率	レッド・アーク・グローバル・ インベストメンツ（ケイマン） トラスト－USエクイティ・ プラス・ロング・コール・ ストラテジーファンド（クラスA）	債券 組入比率	純資産 総額
（設定日） 2026年1月30日	円 10,000	円 －	% －	円 10,000	10,000	% －	% －	% －	百万円 388
1期(2026年2月10日)	10,132	0	1.3	10,132	10,154	1.5	98.5	0.0	400
2期(2026年3月10日)	9,420	0	△7.0	9,420	9,927	△2.2	98.3	0.0	377
3期(2026年4月10日)	9,411	0	△0.1	9,411	10,042	1.2	98.9	0.0	375
4期(2026年5月11日)	10,233	0	8.7	10,233	10,727	6.8	96.6	0.0	408
5期(2026年6月10日)	10,433	0	2.0	10,433	11,104	3.5	96.6	0.0	414
6期(2026年7月10日)	10,740	0	2.9	10,740	11,405	2.7	96.7	0.0	415

（注1）設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。以下同じです。

（注2）基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

（注3）「基準価額＋累計分配金」は、当該決算期の基準価額（分配落）に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

（注4）参考指数はS & P 500指数（配当込み、円ベース）であり、設定時を10,000として指数化しています。

（注5）当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

（注6）作成期とは運用報告書を作成する期間をいい、上表の決算期が当作成期です。以下同じです。

（注7）設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

当作成期中の基準価額と市況等の推移

年月日		基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ（ケイマン） トラスト－USエクイティ・プラス・ロング・コール・ストラテジーファンド（クラスA）	債券組入比率
第1期	（設定日） 2026年 1 月30日	円 10,000	% －	10,000	% －	% －	% －
	（期末） 2026年 2 月10日	10,132	1.3	10,154	1.5	98.5	0.0
第2期	（期首） 2026年 2 月10日	10,132	－	10,154	－	98.5	0.0
	2 月末	9,976	△1.5	10,150	△0.0	98.3	0.0
	（期末） 2026年 3 月10日	9,420	△7.0	9,927	△2.2	98.3	0.0
第3期	（期首） 2026年 3 月10日	9,420	－	9,927	－	98.3	0.0
	3 月末	8,720	△7.4	9,538	△3.9	98.2	0.0
	（期末） 2026年 4 月10日	9,411	△0.1	10,042	1.2	98.9	0.0
第4期	（期首） 2026年 4 月10日	9,411	－	10,042	－	98.9	0.0
	4 月末	10,225	8.6	10,667	6.2	99.0	0.0
	（期末） 2026年 5 月11日	10,233	8.7	10,727	6.8	96.6	0.0
第5期	（期首） 2026年 5 月11日	10,233	－	10,727	－	96.6	0.0
	5 月末	10,659	4.2	11,231	4.7	98.6	0.0
	（期末） 2026年 6 月10日	10,433	2.0	11,104	3.5	96.6	0.0
第6期	（期首） 2026年 6 月10日	10,433	－	11,104	－	96.6	0.0
	6 月末	10,333	△1.0	11,145	0.4	98.5	0.0
	（期末） 2026年 7 月10日	10,740	2.9	11,405	2.7	96.7	0.0

（注）期末基準価額は分配金（税引前）込み、騰落率は期首（第1期は設定日）比です。

売買および取引の状況

2026年1月30日～2026年7月10日

(1) 投資信託証券

	第1期～第6期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ (ケイマン) トラストーUSエクイティ・プラス・ ロング・コール・ストラテジーファンド (クラスA)	408,502	409,070	37,386	39,340

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 口数および金額の単位未満は切り捨てています。以下同じです。

(2) 親投資信託受益証券の設定、解約状況

	第1期～第6期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	9	10	—	—

利害関係人との取引状況等

2026年1月30日～2026年7月10日

当作成期における利害関係人との取引はありません。

組入有価証券明細表

2026年7月10日現在

(1) 投資信託証券

ファンド名	第6期末		
	口数	評価額	比率
	千口	千円	%
レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ (ケイマン) トラストーUSエクイティ・プラス・ ロング・コール・ストラテジーファンド (クラスA)	371,115	401,472	96.7
合計	371,115	401,472	96.7

(注1) 比率は、当作成期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 口数および評価額の単位未満は切り捨てています。以下同じです。

(2) 親投資信託残高

種類	第6期末	
	口数	評価額
	千口	千円
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	9	10

(注) 当作成期末におけるニッセイマネーマーケットマザーファンド全体の口数は5,095,981千口です。

投資信託財産の構成

2026年7月10日現在

項目	第6期末	
	評価額	比率
レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ (ケイマン) トラストーUSエクイティ・プラス・ ロング・コール・ストラテジーファンド (クラスA)	千円 401,472	% 96.6
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	10	0.0
コール・ローン等、その他	14,266	3.4
投資信託財産総額	415,749	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

	(2026年2月10日)	(2026年3月10日)	(2026年4月10日)	(2026年5月11日)	(2026年6月10日)	(2026年7月10日)現在
項目	第1期末	第2期末	第3期末	第4期末	第5期末	第6期末
(A)資産	404,683,771円	377,930,926円	377,559,624円	408,524,161円	414,516,514円	415,749,079円
コール・ローン等	9,928,945	6,948,778	6,538,126	14,382,363	14,654,409	14,266,305
レッド・アーク・グローバル・ インベストメンツ (ケイマン) トラストーUSエクイティ・プラス・ ロング・コール・ストラテジー ファンド (クラスA) (評価額)	394,744,824	370,972,140	371,011,484	394,131,778	399,852,079	401,472,740
ニッセイマネーマーケット マザーファンド(評価額)	10,002	10,008	10,014	10,020	10,026	10,034
(B)負債	4,048,997	408,041	2,278,469	460,439	468,439	461,873
未払金	3,890,000	-	-	-	-	-
未払解約金	-	-	1,852,800	-	-	-
未払信託報酬	157,718	404,752	422,236	456,727	464,660	458,151
その他未払費用	1,279	3,289	3,433	3,712	3,779	3,722
(C)純資産総額(A-B)	400,634,774	377,522,885	375,281,155	408,063,722	414,048,075	415,287,206
元本	395,403,768	400,787,636	398,787,636	398,787,636	396,845,322	386,680,751
次期繰越損益金	5,231,006	△ 23,264,751	△ 23,506,481	9,276,086	17,202,753	28,606,455
(D)受益権総口数	395,403,768口	400,787,636口	398,787,636口	398,787,636口	396,845,322口	386,680,751口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,132円	9,420円	9,411円	10,233円	10,433円	10,740円

(注) 設定元本額 388,074,879円
 当作成期中追加設定元本額 13,712,757円
 当作成期中一部解約元本額 15,106,885円

損益の状況

	(第1期 2026年1月30日～2026年2月10日)			(第4期 2026年4月11日～2026年5月11日)		
	(第2期 2026年2月11日～2026年3月10日)			(第5期 2026年5月12日～2026年6月10日)		
	(第3期 2026年3月11日～2026年4月10日)			(第6期 2026年6月11日～2026年7月10日)		
項目	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期
(A)配当等収益	21,710円	4,456円	3,824円	2,706円	4,533円	5,515円
受取利息	21,710	4,456	3,824	2,706	4,533	5,515
(B)有価証券売買損益	5,404,826	△27,719,949	68,252	33,240,300	8,434,518	12,287,806
売買益	5,404,826	1,767	66,248	33,240,300	8,480,307	12,300,669
売買損	-	△27,721,716	2,004	-	△ 45,789	△ 12,863
(C)信託報酬等	△ 158,997	△ 753,889	△ 432,104	△ 460,439	△ 468,439	△ 461,873
(D)当期損益金(A+B+C)	5,267,539	△28,469,382	△ 360,028	32,782,567	7,970,612	11,831,448
(E)前期繰越損益金	-	5,255,500	△23,095,838	△23,455,866	9,282,510	16,824,086
(分配準備積立金)	(-)	(5,255,500)	(5,231,472)	(5,231,472)	(9,282,510)	(16,824,086)
(繰越欠損金)	(-)	(-)	(△28,327,310)	(△28,687,338)	(-)	(-)
(F)追加信託差損益金*	△ 36,533	△ 50,869	△ 50,615	△ 50,615	△ 50,369	△ 49,079
(配当等相当額)	(-)	(84,970)	(84,546)	(84,546)	(84,134)	(81,979)
(売買損益相当額)	(△ 36,533)	(△ 135,839)	(△ 135,161)	(△ 135,161)	(△ 134,503)	(△ 131,058)
(G)合計(D+E+F)	5,231,006	△23,264,751	△23,506,481	9,276,086	17,202,753	28,606,455
次期繰越損益金(G)	5,231,006	△23,264,751	△23,506,481	9,276,086	17,202,753	28,606,455
追加信託差損益金	△ 36,533	△ 50,869	△ 50,615	△ 50,615	△ 50,369	△ 49,079
(配当等相当額)	(-)	(84,970)	(84,546)	(84,546)	(84,134)	(81,979)
(売買損益相当額)	(△ 36,533)	(△ 135,839)	(△ 135,161)	(△ 135,161)	(△ 134,503)	(△ 131,058)
分配準備積立金	5,267,539	5,255,500	5,231,472	9,326,701	17,253,122	28,655,534
繰越欠損金	-	△28,469,382	△28,687,338	-	-	-

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。

(注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注4) (F)追加信託差損益金*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末(第1期は設定時)の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

分配金の計算過程

項目	第 1 期	第 2 期	第 3 期	第 4 期	第 5 期	第 6 期
(a) 経費控除後の配当等収益	21,074円	0円	0円	2,660円	4,299円	5,330円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	5,246,465円	0円	0円	4,092,569円	7,966,313円	11,826,118円
(c) 信託約款に定める収益調整金	0円	84,970円	84,546円	84,546円	84,134円	81,979円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	0円	5,255,500円	5,231,472円	5,231,472円	9,282,510円	16,824,086円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	5,267,539円	5,340,470円	5,316,018円	9,411,247円	17,337,256円	28,737,513円
(f) 分配対象額 (1 万口当たり)	133.22円	133.25円	133.30円	236.00円	436.88円	743.18円
(g) 分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円
(h) 分配金 (1 万口当たり)	0円	0円	0円	0円	0円	0円

お知らせ

■約款変更

「一般社団法人投資信託協会」と「一般社団法人日本投資顧問業協会」の合併に伴い関連条項に所要の変更を行いました。

（2026年4月1日）

運用者情報

■当社運用担当者情報について

・当社の運用担当者情報はHP上よりご確認ください。

■ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド（毎月決算・予想分配金提示型）



<https://www.nam.co.jp/fundinfo/nbkbsfm/main.html>

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／株式														
信 託 期 間	2026年1月30日～2036年1月10日														
運 用 方 針	外国投資信託証券への投資を通じて、実質的にS & P 5 0 0 指数を原資産とする先物取引とオプション取引を行うとともに、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受をめざすことにより、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。														
主要運用対象	ニッセイ米国株式 ブースト戦略ファンド (毎月決算・予想分配金提示型)	「レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ（ケイマン）トラ スト-U S エクイティ・プラス・ロング・コール・ストラテジーファ ンド（クラスA）」および「ニッセイマネーマーケットマザーファンド」													
	レッド・アーク・グローバル・インベ ストメンツ（ケイマン）トラスト-U S エクイティ・プラス・ロング・コール・ ストラテジーファンド（クラスA）	・ S & P 5 0 0 指数を原資産とする先物取引とオプション取引、お よび米ドル買い円売りの為替取引 ・ 円建ての短期公社債および短期金融商品													
	ニッセイマネーマーケッ トマザーファンド	円建ての短期公社債および短期金融商品													
運 用 方 法	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・ 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ・ 外貨建資産への直接投資は行いません。 ・ 株式への直接投資は行いません。														
分 配 方 針	毎月10日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、決算日の前営業日の基準価額に応じた分配をめざします。 分配対象額は、経費控除後の配当等収益および売買益等の全額とします。 収益分配方針に基づき、原則として決算日の前営業日の基準価額（1万口当たり。支払い済みの分配金累計額は加算しません。）に応じて、以下の金額の分配を行うことをめざします。														
	<table><tr><th>決算日の前営業日の基準価額</th><th>分配金額（1万口当たり、税引前）</th></tr><tr><td>11,000円未満</td><td>基準価額の水準等を勘案して決定</td></tr><tr><td>11,000円以上12,000円未満</td><td>200円</td></tr><tr><td>12,000円以上13,000円未満</td><td>300円</td></tr><tr><td>13,000円以上14,000円未満</td><td>400円</td></tr><tr><td>14,000円以上</td><td>500円</td></tr></table>			決算日の前営業日の基準価額	分配金額（1万口当たり、税引前）	11,000円未満	基準価額の水準等を勘案して決定	11,000円以上12,000円未満	200円	12,000円以上13,000円未満	300円	13,000円以上14,000円未満	400円	14,000円以上	500円
	決算日の前営業日の基準価額	分配金額（1万口当たり、税引前）													
	11,000円未満	基準価額の水準等を勘案して決定													
	11,000円以上12,000円未満	200円													
	12,000円以上13,000円未満	300円													
	13,000円以上14,000円未満	400円													
	14,000円以上	500円													
	・ 分配対象額が少額の場合、あるいは決算日の前営業日から決算日までに基準価額が急激に変動した場合等には、上記とは異なる分配金額となる場合や分配金が支払われない場合があります。また、委託会社の判断により、分配を行わないことがあります。														
	・ 基準価額の値上がりにより、該当する分配金テーブルが分配金の支払い準備のために用意していた資金を超える場合等には、テーブル通りの分配ができないことがあります。														
・ 基準価額に応じて、毎月の分配金額は変動します。基準価額があらかじめ決められた水準に一度でも到達すれば、その水準に応じた分配を継続するというものではありません。															
・ 分配を行うことにより基準価額は下落します。そのため、基準価額に影響を与え、次期決算以降の分配金額は変動する場合があります。また、あらかじめ一定の分配金額を保証するものではありません。															
※分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して決定します。															
※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。															

ニッセイマネーマーケット マザーファンド

運用報告書

第 29 期

(計算期間：2025年10月16日～2026年4月15日)

運用方針

- ① 円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。
- ② 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。

主要運用 対象

円建ての短期公社債および短期金融商品

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。
・ 外貨建資産への投資は行いません。



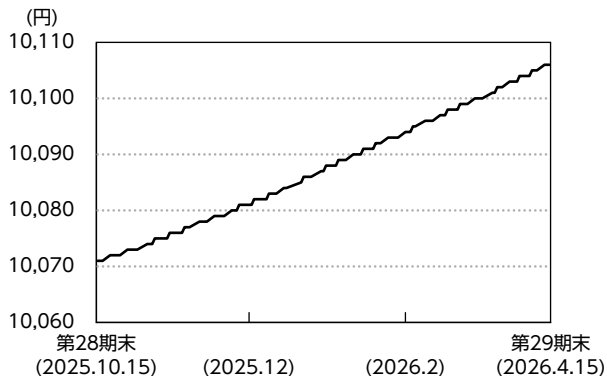
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2025年10月16日～2026年4月15日

基準価額等の推移



■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・前期末以降、利子等収益等が積み上がったこと

(注) 当マザーファンドはベンチマークを設けていません。

ポートフォリオ

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざしました。

ベンチマークとの差異

当マザーファンドは、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざして運用を行うことから、コンセプトに適った指数が存在しないため、ベンチマークなどを設けていません。

今後の運用方針

当マザーファンドは、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。

今後も引き続き、安定した収益確保のため、短期証券を中心に投資していく方針です。

お知らせ

■約款変更

「一般社団法人投資信託協会」と「一般社団法人日本投資顧問業協会」の合併に伴い関連条項に所要の変更を行いました。

(2026年4月1日)

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		
	円	%	%	百万円
25期 (2024年 4 月15日)	10,025	0.0	83.1	1,391
26期 (2024年10月15日)	10,028	0.0	92.2	1,375
27期 (2025年 4 月15日)	10,043	0.1	73.1	2,007
28期 (2025年10月15日)	10,071	0.3	75.5	2,053
29期 (2026年 4 月15日)	10,106	0.3	63.5	4,800

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	債券 組入比率
	円	%	%
(期首)2025年10月15日	10,071	—	75.5
10月末	10,073	0.0	74.8
11月末	10,078	0.1	79.6
12月末	10,084	0.1	70.8
2026年 1 月末	10,091	0.2	68.3
2 月末	10,096	0.2	68.5
3 月末	10,103	0.3	63.3
(期末)2026年 4 月15日	10,106	0.3	63.5

(注) 騰落率は期首比です。

ニッセイマネーマーケットマザーファンド

1万口当たりの費用明細

2025年10月16日～2026年4月15日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料	－円	－％	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	－	－	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
合計	－	－	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(10,088円)で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2025年10月16日～2026年4月15日

公社債

		買付額	売付額
国内	地方債証券	千円 1,865,937	千円 － (557,000)
	特殊債券	181,642	－

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 金額の単位未満は切り捨てています。ただし、金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

主要な売買銘柄

2025年10月16日～2026年4月15日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
第1回 東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	498,120	—	—
令和3年度第6回 埼玉県公募公債(5年)	497,630		
平成28年度第4回 京都市公募公債	298,041		
第760回 東京都公募公債	286,297		
平成28年度第1回 静岡市公募公債	285,848		
第291回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,642		

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2026年4月15日現在

国内（邦貨建）公社債

区分	額面金額	評価額	組入比率	当期末 うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	2,875,000 (2,875,000)	2,868,386 (2,868,386)	59.8 (59.8)	—	—	—	59.8 (59.8)
特殊債券 (除く金融債券)	183,000 (183,000)	182,220 (182,220)	3.8 (3.8)	—	—	—	3.8 (3.8)
合計	3,058,000 (3,058,000)	3,050,606 (3,050,606)	63.5 (63.5)	—	—	—	63.5 (63.5)

(注1) 評価については、原則として証券会社、価格情報会社等よりデータを入手しています。ただし、残存期間1年以内の公社債については、償却原価法により評価しています。以下同じです。

(注2) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注4) 額面金額および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、額面金額および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。以下同じです。

(国内公社債の内訳)

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
地方債証券	第756回 東京都公募公債	0.0500	2026/ 6 /19	182,000	181,821
	第760回 東京都公募公債	0.0450	2026/ 9 /18	288,000	287,005
	第1回 東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	0.0050	2026/ 6 /19	500,000	499,305
	平成28年度第5回 愛知県公募公債	0.0700	2026/ 6 /29	182,000	181,792
	平成28年度第1回 広島県公募公債	0.0800	2026/ 5 /25	181,000	180,885
	令和3年度第6回 埼玉県公募公債(5年)	0.0050	2026/ 7 /28	500,000	498,853
	第158回 共同発行市場公募地方債	0.0800	2026/ 5 /25	182,000	181,883
	第160回 共同発行市場公募地方債	0.0500	2026/ 7 /24	272,000	271,516
	平成28年度第1回 静岡市公募公債	0.0600	2026/11/25	288,000	286,561
	平成28年度第4回 京都市公募公債	0.0700	2026/10/23	300,000	298,760
	小計	—	—	—	2,868,386
特殊債券 (除く金融債券)	第291回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.0050	2026/10/30	183,000	182,220
	小計	—	—	—	182,220
	合計	—	—	—	3,050,606

投資信託財産の構成

2026年4月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	3,050,606	63.3
コール・ローン等、その他	1,766,379	36.7
投資信託財産総額	4,816,986	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2026年4月15日現在)

項目	当期末
(A)資産	4,816,986,155円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,766,041,463
公 社 債 (評価額)	3,050,606,642
未 収 利 息	284,533
前 払 費 用	53,517
(B)負債	16,465,227
未 払 解 約 金	16,465,227
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	4,800,520,928
元 本	4,750,142,861
次 期 繰 越 損 益 金	50,378,067
(D)受 益 権 総 口 数	4,750,142,861口
1万口当たり基準価額 (C / D)	10,106円

(注1) 期首元本額 2,038,753,014円
 期中追加設定元本額 3,167,158,192円
 期中一部解約元本額 455,768,345円

(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。

ニッセイグローバル好配当株式プラス (毎月決算型)	10,000円
ニッセイマネーマーケットファンド (適格機関投資家限定)	49,754,738円
ニッセイ豪州ハイ・インカム株式ファンド (毎月決算型)	9,994円
ニッセイアメリカ高配当株ファンド (毎月決算型)	9,984円
ニッセイアメリカ高配当株ファンド (年2回決算型)	9,984円
ニッセイ世界高配当株ファンド (毎月決算型)	9,984円
ニッセイ世界高配当株ファンド (年2回決算型)	9,984円
J P X日経400アクティブ・オープンミドル投資型	9,976円
J P X日経400アクティブ・プレミアム・オープン (毎月決算型)	9,976円
ニッセイ・オーストラリア・リート・オープン (毎月決算型)	9,974円
ニッセイ・オーストラリア・リート・オープン (年2回決算型)	9,974円
ニッセイA I 関連株式ファンド (為替ヘッジあり)	9,967円
ニッセイA I 関連株式ファンド (為替ヘッジなし)	9,967円
ニッセイ豪州ハイ・インカム株式ファンド (資産成長型)	9,968円
D Cニッセイターゲットデットファンド2035	466,742,032円
D Cニッセイターゲットデットファンド2025	2,683,450,997円
ニッセイ/コムジェスト新興国成長株ファンド (資産成長型)	9,969円
ニッセイ/コムジェスト新興国成長株ファンド (年2回決算型)	9,969円
ニッセイA I 関連株式ファンド (年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,969円
ニッセイA I 関連株式ファンド (年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,969円
D Cニッセイターゲットデットファンド2030	1,549,776,508円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド (年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,970円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド (年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,970円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド (資産成長型・為替ヘッジあり)	9,970円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド (資産成長型・為替ヘッジなし)	9,970円
グローバル・ディスラプター成長株ファンド (予想分配金提示型)	9,972円
グローバル・ディスラプター成長株ファンド (資産成長型)	9,972円
ニッセイ新興国テクノロジー関連株式ファンド (予想分配金提示型)	9,972円
ニッセイ新興国テクノロジー関連株式ファンド (資産成長型)	9,972円
ニッセイ/シュローダー好利回りCBファンド2023-02 (為替ヘッジあり・限定創設型)	9,974円
限定創設型・最上乗額限定ニッセイ世界1カ国株式厳選ファンド2023-07 (為替ヘッジあり)	9,975円
ニッセイ・マルチアセット・インカム戦略ファンド (資産成長型)	9,975円
ニッセイ・マルチアセット・インカム戦略ファンド (毎月決算型)	9,975円
ニッセイS & P 500リカバリー戦略株式ファンド	9,973円
ニッセイ・インド中小型株式ファンド	9,969円
ニッセイ・インド株式ファンド<購入・換金手数料なし>	9,964円
ニッセイ・インド株式オープン (資産成長型)	9,939円
ニッセイ・インド株式オープン (3ヵ月決算型)	9,939円
ニッセイ/シュローダー好利回りCBファンド2025-09 (為替ヘッジなし・限定創設型)	9,934円
ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド (毎月決算・予想分配金提示型)	9,910円
ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド<為替リスク限定型> (毎月決算・予想分配金提示型)	9,910円
ニッセイ/シュローダー好利回りCBファンド2026-03 (為替ヘッジなし・限定創設型)	9,901円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (毎月決算型・為替ヘッジあり)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (毎月決算型・為替ヘッジなし)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,968円

損益の状況

当期 (2025年10月16日～2026年4月15日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	4,472,125円
受 取 利 息	4,472,125
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	8,863,414
売 買 益	8,863,414
(C)当 期 損 益 金 (A + B)	13,335,539
(D)前 期 繰 越 損 益 金	14,433,829
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	26,792,804
(F)解 約 差 損 益 金	△ 4,184,105
(G)合 計 (C + D + E + F)	50,378,067
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	50,378,067

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (E)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。

(注3) (F)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・ S & P 5 0 0 指数（配当込み、円ベース）

S & P 5 0 0 指数は、S&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、Standard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切の責任を負いません。